

国寿安保中证同业存单 AAA 指数  
7 天持有期证券投资基金  
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：广发银行股份有限公司

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。

基金托管人广发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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 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             | 10        |
| 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        |
| <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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表                              | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>32</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 32        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 33        |
| 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       | 33        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 33        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 33        |
| 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      | 34        |
| 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   | 34        |
| 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   | 34        |
| 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      | 34        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 34        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 34        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 34        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>36</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 36        |
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                      | 36        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 36        |
| 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 .....   | 37        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>37</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>37</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 37        |
| 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 .....   | 37        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 38        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 38        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 38        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 38        |
| 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 .....   | 38        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 39        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>40</b> |
| 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 ..... | 40        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 40        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>40</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 40        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 41        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 41        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                |
|------------|--------------------------------|
| 基金名称       | 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称       | 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期       |
| 基金主代码      | 019121                         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                         |
| 基金合同生效日    | 2023 年 12 月 4 日                |
| 基金管理人      | 国寿安保基金管理有限公司                   |
| 基金托管人      | 广发银行股份有限公司                     |
| 报告期末基金份额总额 | 9,389,625.62 份                 |
| 基金合同存续期    | 不定期                            |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪业绩比较基准，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资策略   | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，将年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。 |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times$ 5%。                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数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              | 广发银行股份有限公司                 |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 韩占锋                       | 顾洪峰                        |
|             | 联系电话 | 010-50850888              | 010-65169885               |
|             | 电子邮箱 | service@gsfunds.com.cn    | guhongfeng@cgbchina.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4009-258-258              | 4008308003                 |
| 传真          |      | 010-50850777              | 010-65169555               |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号 | 广东省广州市越秀区东风东路 713 号        |
| 办公地址        |      | 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰        | 北京市西城区金融大街 15 号鑫           |

|       |                |           |
|-------|----------------|-----------|
|       | 商务中心 2 号楼 11 层 | 茂大厦北楼 4 楼 |
| 邮政编码  | 100033         | 100032    |
| 法定代表人 | 于泳             | 林朝晖       |

## 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 | <a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a> |
| 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 | 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<br>盈泰商务中心 2 号楼 11 层 |

# § 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       | 63,281.25                             |
| 本期利润          | 62,263.55                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0047                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.45%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.43%                                 |
| 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      | 359,021.97                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0382                                |
| 期末基金资产净值      | 9,773,779.70                          |
| 期末基金份额净值      | 1.0409                                |
| 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   | 4.09%                                 |

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

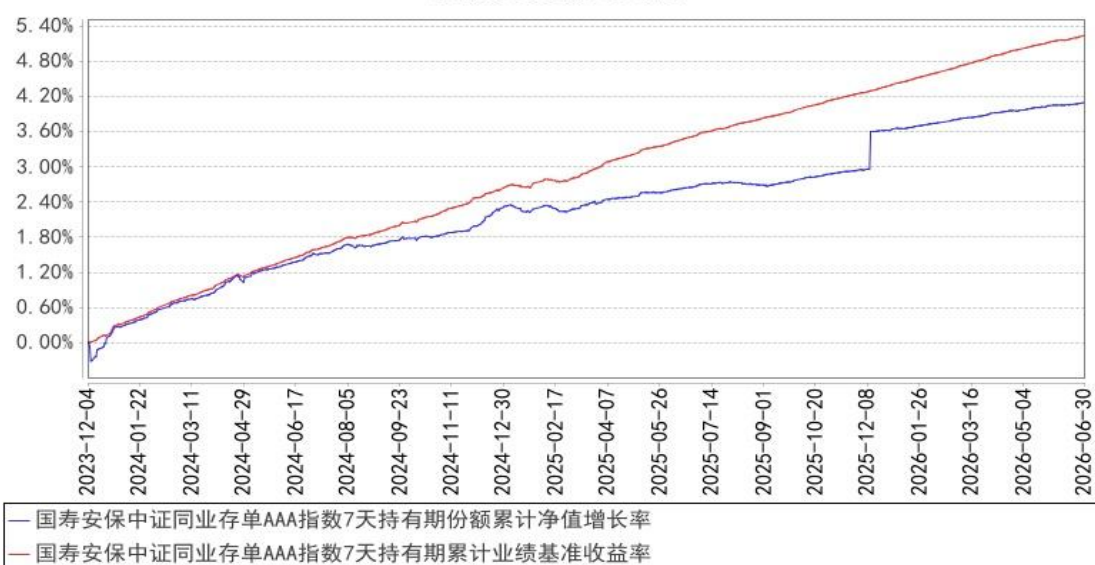
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值<br>增长率① | 份额净值增长<br>率标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------------|-----------------|----------------|-------------------|-----|-----|
|----|--------------|-----------------|----------------|-------------------|-----|-----|

|            |        |        |        |        |         |        |
|------------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|
| 过去三个月      | 0.19 % | 0.01 % | 0.37 % | 0.00 % | -0.18 % | 0.01 % |
| 过去六个月      | 0.43 % | 0.01 % | 0.80 % | 0.01 % | -0.37 % | 0.00 % |
| 过去一年       | 1.38 % | 0.04 % | 1.65 % | 0.01 % | -0.27 % | 0.03 % |
| 自基金合同生效起至今 | 4.09 % | 0.03 % | 5.24 % | 0.01 % | -1.15 % | 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

国寿安保中证同业存单AAA指数7天持有期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



注：本基金基金合同生效日为 2023 年 12 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 2023 年 12 月 04 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                                                                                                 |
|---------|--------------|----------------------|------|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         |              | 任职日期                 | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                    |
| 张英      | 本基金的<br>基金经理 | 2023 年<br>12 月 4 日   | —    | 14 年       | 曾任中国人寿资产管理有限公司国际部研究员。2013 年加入国寿安保基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任国寿安保添利货币市场基金、国寿安保聚宝盆货币市场基金、国寿安保增金宝货币市场基金、国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金及国寿安保薪金宝货币市场基金和国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。 |
| 杜青<br>颖 | 本基金的<br>基金经理 | 2026 年 4<br>月 8 日    | —    | 7 年        | 硕士，CFA、FRM，曾任粤开证券股份有限公司资管部运营专员、交易员，2020 年 10 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。现任国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国寿安保增金宝货币市场基金、国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金基金经理。          |

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合规守信情况的说明

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

2026 年上半年，全球金融市场受地缘政治与海外货币政策双重扰动。2 月底中东地缘冲突升级，引发原油价格波动、全球风险偏好收缩，通胀预期阶段性抬升。海外方面，美联储降息预期持续降温，美元指数触底反弹，外部金融环境边际收紧，人民币汇率升值节奏放缓，呈现双向波动格局。国内跨境调控政策托底有力，跨境资金流动总体平稳可控。

国内经济上半年呈现“开局回暖、延续弱修复”态势。一季度 1-2 月经济整体向好，出口、消费表现超预期，上海优化限购政策后，一线城市房地产市场迎来阶段性小阳春。进入二季度，经济修复动能有所放缓，内需偏弱成为核心矛盾，居民消费信心修复偏慢，房地产市场整体低迷，固定资产投资承压，制造业 PMI 在荣枯线附近震荡。物价端温和改善，CPI 稳步修复，PPI 降幅持续收窄，但整体仍处低位，终端需求不足制约企业盈利修复节奏。

货币政策坚持稳健偏松基调，6 月底央行推出隔夜逆回购工具，健全短端利率调控体系，有效熨平阶段性资金扰动，抑制资金空转，引导市场杠杆有序回落。一季度，银行存量到期存款续作表现好于预期，银行体系流动性充裕；人民币升值推升结汇需

求，叠加同业活期自律机制落地带来资产端重定价，货币市场收益率持续下行。二季度流动性结构性特征凸显，4-5 月中上旬资金充裕，隔夜利率持续下探；5 月下旬，大行下调活期存款利率引发非银资金阶段性撤出，叠加银行信贷冲量，资金面出现阶段性收敛，市场利率有所上行。存单收益率与资金行情联动，先下探至阶段低点，随后迎来小幅修复。

本基金秉持审慎投资原则，在确保组合流动性、安全性基础上，以投资价值较高的存单为主，加强波段操作，在关键时点保持流动性，抢抓配置机会。下一阶段将继续审慎操作，择优配置具有更高性价比的资产，力争保持组合收益的稳定性和持续性。

#### 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 1.0409 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%，业绩比较基准收益率为 0.80%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外市场仍存在多重不确定性。中东地缘波动或将持续扰动油价与全球通胀预期。美国经济呈现韧性走弱迹象，2026 年二季度 GDP 年化增速 1.5%，低于一季度 2.1%，增长动能有所回落；6 月整体 PCE 同比 3.7%、核心 PCE 同比 3.3%，通胀黏性仍存，叠加就业数据偏弱，经济冷热交织或加剧美联储政策博弈，后续需持续跟踪海外数据、美联储政策及地缘变化。

国内方面，下半年政策有望延续稳增长基调，财政货币协同发力，货币政策坚持稳健偏松，调控灵活性有望提升。国内 GDP 大概率维持弱修复、结构分化态势，消费修复或偏温和，整体通胀或延续低位运行；投资端或持续分化，基建小幅托底，制造业与地产修复偏弱，或持续压制内需复苏。实体信贷需求改善或相对有限，市场利率难现趋势性上行，资金面或随信贷、财政及季节性因素呈现松紧交替特征。权益市场或呈现结构性行情，阶段性资金分流或对固收市场形成小幅扰动，货币市场宽松环境有望延续。

整体来看，我们认为国内经济将延续弱修复，货币环境持续均衡偏宽松，不排除信贷冲量、政府债集中发行等因素扰动呈阶段性收敛，需持续关注货币政策工具的调整及年底是否会出现机构资产负债行为的扰动。

#### 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验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 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

本基金自 2025 年 06 月 11 日至 2026 年 06 月 30 日基金资产净值低于五千万元，且已超过 60 个工作日，基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

### § 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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： 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 2,793,096.06           | 2,200,996.54             |
| 结算备付金    |         | -                      | -                        |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 6,968,059.11           | 20,686,346.67            |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 6,968,059.11           | 20,686,346.67            |
| 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    |         | -                      | -                        |
| 应收股利     |         | -                      | -                        |
| 应收申购款    |         | 10,131.00              | 4,348.46                 |
| 递延所得税资产  |         | -                      | -                        |
| 其他资产     | 6.4.7.8 | 9,300.00               | 3,133.20                 |
| 资产总计     |         | 9,780,586.17           | 22,894,824.87            |
| 负债和净资产   | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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       |          | -            | -             |
| 应付赎回款       |          | -            | -             |
| 应付管理人报酬     |          | 1,326.59     | 2,193.53      |
| 应付托管费       |          | 331.64       | 548.41        |
| 应付销售服务费     |          | 1,326.59     | 109.68        |
| 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  | 3,821.65     | 9,194.31      |
| 负债合计        |          | 6,806.47     | 12,045.93     |
| <b>净资产：</b> |          |              |               |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 9,389,625.62 | 22,079,319.50 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -            | -             |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 384,154.08   | 803,459.44    |
| 净资产合计       |          | 9,773,779.70 | 22,882,778.94 |
| 负债和净资产总计    |          | 9,780,586.17 | 22,894,824.87 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0409 元，基金份额总额 9,389,625.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | 105,052.82                               | 473,643.79                                    |
| 1. 利息收入           |          | 2,850.47                                 | 20,916.64                                     |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 2,850.47                                 | 691.74                                        |
| 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        |          | -                                        | 20,224.90                                     |
| 其他利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 103,220.05                               | 635,813.31                                    |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益            |          | -                                        | -                                             |

|                                 |            |            |             |
|---------------------------------|------------|------------|-------------|
| 债券投资收益                          | 6.4.7.15   | 103,220.05 | 635,813.31  |
| 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   | -          | -           |
| 以摊余成本计量的金融资产<br>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“-”<br>号填列）      | 6.4.7.20   | -1,017.70  | -183,086.16 |
| 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   | -          | -           |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 42,789.27  | 370,921.52  |
| 1. 管理人报酬                        | 6.4.10.2.1 | 13,779.71  | 88,176.44   |
| 其中：暂估管理人报酬                      |            | -          | -           |
| 2. 托管费                          | 6.4.10.2.2 | 3,444.96   | 22,044.11   |
| 3. 销售服务费                        | 6.4.10.2.3 | 13,779.71  | 79,837.87   |
| 4. 投资顾问费                        |            | -          | -           |
| 5. 利息支出                         |            | 11,784.89  | 106,095.08  |
| 其中：卖出回购金融资产支出                   |            | 11,784.89  | 106,095.08  |
| 6. 信用减值损失                       | 6.4.7.22   | -          | -           |
| 7. 税金及附加                        |            | -          | 203.50      |
| 8. 其他费用                         | 6.4.7.23   | -          | 74,564.52   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号<br/>填列）</b> |            | 62,263.55  | 102,722.27  |
| 减：所得税费用                         |            | -          | -           |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>        |            | 62,263.55  | 102,722.27  |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>            |            | -          | -           |
| <b>六、综合收益总额</b>                 |            | 62,263.55  | 102,722.27  |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |            |               |
|-----------|---------------------------------------|----------------|------------|---------------|
|           | 实收基金                                  | 其他<br>综合<br>收益 | 未分配利润      | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产 | 22,079,319.50                         | -              | 803,459.44 | 22,882,778.94 |
| 加：会计政策变更  | -                                     | -              | -          | -             |
| 前期差错更正    | -                                     | -              | -          | -             |

|                                          |                                            |        |               |                 |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|---------------|-----------------|
| 其他                                       | -                                          | -      | -             | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 22,079,319.50                              | -      | 803,459.44    | 22,882,778.94   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -12,689,693.88                             | -      | -419,305.36   | -13,108,999.24  |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 62,263.55     | 62,263.55       |
| (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)      | -12,689,693.88                             | -      | -481,568.91   | -13,171,262.79  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 27,572,971.48                              | -      | 1,022,220.79  | 28,595,192.27   |
| 2. 基金赎回款                                 | -40,262,665.36                             | -      | -1,503,789.70 | -41,766,455.06  |
| (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                                | 9,389,625.62                               | -      | 384,154.08    | 9,773,779.70    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 257,430,650.84                             | -      | 5,985,643.95  | 263,416,294.79  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -             | -               |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -             | -               |
| 其他                                       | -                                          | -      | -             | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 257,430,650.84                             | -      | 5,985,643.95  | 263,416,294.79  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -215,914,345.55                            | -      | -4,877,660.81 | -220,792,006.36 |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 102,722.27    | 102,722.27      |
| (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)      | -215,914,345.55                            | -      | -4,980,383.08 | -220,894,728.63 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 64,563,110.70                              | -      | 1,589,661.31  | 66,152,772.01   |
| 2. 基金赎回款                                 | -280,477,456.25                            | -      | -6,570,044.39 | -287,047,500.64 |
| (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                                | 41,516,305.29                              | -      | 1,107,983.14  | 42,624,288.43   |

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

王文英

于晓树

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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[2023]1670 号《关于准予国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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《国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 434,797,442.93 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0586 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 434,911,865.91 份基金份额,其中认购资金利息折合 114,422.98 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”),基金托管人为广发银行股份有限公司(以下简称“广发银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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的成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、政府支持债券、政府支持机构债券等)、非金融企业债务融资工具(包括短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款和其他银行存款等)、现金等货币市场工具等,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的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金不投资于股票,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。基金的投资组合比例为:本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%;本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%;本基金持有的现金或者到期日在一年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、应收申购款等。如法律法规或监管机构变



更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率 $\times$ 95%+ 银行人民币一年定期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 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》《国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2026 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 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[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》、财政部、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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局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) 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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品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% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,793,096.06           |
| 等于：本金          | 2,792,859.03           |
| 加：应计利息         | 237.03                 |
| 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             | 2,793,096.06           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |              |        |
|---------------|-------|------------------------|-----------|--------------|--------|
|               |       | 成本                     | 应计利息      | 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 | -                      | -         | -            | -      |
|               | 银行间市场 | 6,912,257.80           | 55,499.11 | 6,968,059.11 | 302.20 |
|               | 合计    | 6,912,257.80           | 55,499.11 | 6,968,059.11 | 302.20 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -         | -            | -      |
| 基金            |       | -                      | -         | -            | -      |
| 其他            |       | -                      | -         | -            | -      |
| 合计            |       | 6,912,257.80           | 55,499.11 | 6,968,059.11 | 302.20 |

### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息  | —                      |
| 其他应收款 | 9,300.00               |
| 待摊费用  | —                      |
| 合计    | —                      |

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>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      | 3,821.65               |
| 其中：交易所市场    | —                      |
| 银行间市场       | 3,821.65               |
| 应付利息        | —                      |
| 合计          | 3,821.65               |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 22,079,319.50                         | 22,079,319.50  |
| 本期申购          | 27,572,971.48                         | 27,572,971.48  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -40,262,665.36                        | -40,262,665.36 |
| 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           | 9,389,625.62                          | 9,389,625.62   |

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。

#### 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           | 738,452.45    | 65,006.99   | 803,459.44    |
| 加：会计政策变更       | -             | -           | -             |
| 前期差错更正         | -             | -           | -             |
| 其他             | -             | -           | -             |
| 本期期初           | 738,452.45    | 65,006.99   | 803,459.44    |
| 本期利润           | 63,281.25     | -1,017.70   | 62,263.55     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -442,711.73   | -38,857.18  | -481,568.91   |
| 其中：基金申购款       | 943,187.03    | 79,033.76   | 1,022,220.79  |
| 基金赎回款          | -1,385,898.76 | -117,890.94 | -1,503,789.70 |
| 本期已分配利润        | -             | -           | -             |
| 本期末            | 359,021.97    | 25,132.11   | 384,154.08    |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |  |
|----------|---------------------------------------|--|
|          |                                       |  |
| 活期存款利息收入 | 2,850.47                              |  |
| 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 | —        |
| 其他        | —        |
| 合计        | 2,850.47 |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 108,994.40                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -5,774.35                  |
| 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                           | 103,220.05                 |

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 30,474,632.56              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,186,842.20              |
| 减：应计利息总额               | 287,017.46                 |
| 减：交易费用                 | 6,547.25                   |
| 买卖债券差价收入               | -5,774.35                  |

#### 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**

本基金于本报告期无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -1,017.70                             |
| 股票投资                   | -                                     |
| 债券投资                   | -1,017.70                             |
| 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                     | -1,017.70                             |

**6.4.7.21 其他收入**

本基金于本报告期间无其他收入。

**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**

本基金本报告期无其他费用。根据国寿安保基金管理有限公司决议，本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费用、信息披露费等。

**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、注册登记机构、直销机构      |
| 广发银行                     | 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               |
| 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、销售机构 |
| 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。

#### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 13,779.71                                | 88,176.44                                     |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 6,514.03                                 | 42,274.63                                     |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 7,265.68                                 | 45,901.81                                     |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6<br>月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,444.96                                 | 22,044.11                                     |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% / \text{当年天数}$$

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

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |
|----------------|--------------------------------------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |
|                | 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期                   |
| 广发银行           | 7,056.11                                   |
| 中国人寿           | 36.62                                      |
| 合计             | 7,092.73                                   |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |
|                | 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期                   |
| 广发银行           | 22,550.91                                  |
| 国寿安保           | 274.59                                     |
| 中国人寿           | 34.24                                      |
| 合计             | 22,859.74                                  |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

自 2025 年 5 月 29 日至 2025 年 12 月 31 日开展销售服务费优惠活动，销售服务费率从 0.20% 调整至 0.01%，自 2026 年 1 月 1 日起恢复至 0.20%。

**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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>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 |
| 广发银行  | 2,793,096.06                          | 2,850.47 | 543,843.91                                 | 636.78 |

注：本基金的银行存款由基金托管人广发银行保管，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

根据国寿安保基金管理有限公司决议，本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费用、信息披露费等。

#### 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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 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<br>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                     | 2,793,096.06  | -     | -     | -         | 2,793,096.06  |
| 交易性金融资产                  | 6,968,059.11  | -     | -     | -         | 6,968,059.11  |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 10,131.00 | 10,131.00     |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | 9,300.00  | 9,300.00      |
| 资产总计                     | 9,761,155.17  | -     | -     | 19,431.00 | 9,780,586.17  |
| 负债                       |               |       |       |           |               |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 1,326.59  | 1,326.59      |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 331.64    | 331.64        |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 1,326.59  | 1,326.59      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 3,821.65  | 3,821.65      |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 6,806.47  | 6,806.47      |
| 利率敏感度缺口                  | 9,761,155.17  | -     | -     | 12,624.53 | 9,773,779.70  |
| 上年度末<br>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                     | 2,200,996.54  | -     | -     | -         | 2,200,996.54  |
| 交易性金融资产                  | 20,686,346.67 | -     | -     | -         | 20,686,346.67 |
| 应收申购款                    | -             | -     | -     | 4,348.46  | 4,348.46      |
| 其他资产                     | -             | -     | -     | 3,133.20  | 3,133.20      |
| 资产总计                     | 22,887,343.21 | -     | -     | 7,481.66  | 22,894,824.87 |
| 负债                       |               |       |       |           |               |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 2,193.53  | 2,193.53      |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 548.41    | 548.41        |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 109.68    | 109.68        |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 9,194.31  | 9,194.31      |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 12,045.93 | 12,045.93     |
| 利率敏感度缺口                  | 22,887,343.21 | -     | -     | -4,564.27 | 22,882,778.94 |

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

|    |                                   |                             |                        |
|----|-----------------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；          |                             |                        |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基准点，其他变量不变； |                             |                        |
|    | 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。   |                             |                        |
| 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） |
|    | +25 个基准点                          | -5,599.01                   | -17,775.37             |
|    | -25 个基准点                          | 5,609.97                    | 17,814.52              |

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无重大其他价格风险(2025 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资(2025 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 6,968,059.11           | 20,686,346.67            |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 6,968,059.11           | 20,686,346.67            |

##### 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  | -  | -             |
|    | 其中：股票 | -  | -             |



|   |                   |              |        |
|---|-------------------|--------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -            | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 6,968,059.11 | 71.24  |
|   | 其中：债券             | 6,968,059.11 | 71.24  |
|   | 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      | 2,793,096.06 | 28.56  |
| 8 | 其他各项资产            | 19,431.00    | 0.20   |
| 9 | 合计                | 9,780,586.17 | 100.00 |

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未买入股票。

### 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

本基金本报告期末未卖出股票。

### 7.4.3 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买卖股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -    | -            |
| 2  | 央行票据      | -    | -            |
| 3  | 金融债券      | -    | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -    | -            |

|    |           |              |       |
|----|-----------|--------------|-------|
| 4  | 企业债券      | -            | -     |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -     |
| 6  | 中期票据      | -            | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -     |
| 8  | 同业存单      | 6,968,059.11 | 71.29 |
| 9  | 其他        | -            | -     |
| 10 | 合计        | 6,968,059.11 | 71.29 |

## 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

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  | 112513089 | 25 浙商银行 CD089 | 8,000 | 799,155.29 | 8.18         |
| 2  | 112619020 | 26 恒丰银行 CD020 | 8,000 | 793,639.05 | 8.12         |
| 3  | 112502257 | 25 工商银行 CD257 | 6,000 | 598,167.60 | 6.12         |
| 3  | 112504063 | 25 中国银行 CD063 | 6,000 | 598,167.60 | 6.12         |
| 5  | 112610114 | 26 兴业银行 CD114 | 6,000 | 598,146.57 | 6.12         |

## 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，浙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、国家外汇管理局、中国人民银行、中

国人民银行分支行的处罚；恒丰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的处罚；中国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、地方市场监督管理局、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、国家外汇管理局、证监会分局、中国人民银行分支行的处罚；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国税局、地方市场监督管理局、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、国家外汇管理局、生态环境部、中国人民银行、中国人民银行分支行的处罚；兴业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、国家外汇管理局、中国人民银行分支行的处罚；交通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、国家外汇管理局、中国人民银行、中国人民银行分支行的处罚；中国建设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、地方市场监督管理局、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、国家外汇管理局、生态环境部、银保监分局、证监会分局、中国人民银行、中国人民银行分支行的处罚；中国民生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、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、国家外汇管理局、中国人民银行分支行的处罚；平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到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的处罚；华夏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、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、证监会分局、中国人民银行、中国人民银行分支行的处罚。

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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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 | -         |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 10,131.00 |
| 6  | 其他应收款 | 9,300.00  |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 19,431.00 |

**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**

本基金本报告期末未持有股票。

**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<br>(户) | 户均持有的<br>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(%) |
| 466          | 20,149.41     | -     | -         | 9,389,625.62 | 100.00    |

**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 | 452,010.80 | 4.81 |
|------------------|------------|------|

#### 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                | 10~50             |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 4 日）基金份额总额 | 434,911,865.91 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 22,079,319.50  |
| 本报告期基金总申购份额                    | 27,572,971.48  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 40,262,665.36  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 9,389,625.62   |

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议了《关于国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金持续运作的议案》。大会投票时间自 2026 年 1 月 22 日起至 2026 年 2 月 25 日 17:00 止（具体不同方式的送达时间以大会公告规定的时间为准）。2026 年 2 月 26 日在本基金托管人广发银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人对本次基金份额持有人大会表决情况进行了计票，北京市方圆公证处对计票过程及结果进行了公证，广东信达律师事务所对计票过程进行了见证。根据计票结果，本人直接或委托授权代表出具有效表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额未达到在权益登记日基金份额总数的二分之一，未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。

#### 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。

2026 年 2 月 28 日，本基金托管人广发银行股份有限公司工作安排，安琦瑜先生

不再担任资产托管部总经理助理。

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，会计师事务所为容诚会计师事务所（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

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚等情况。

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 (%) |    |
| 广发证券 | 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 (%) |
| 广发证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

## 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  | 国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金份额持有人大会的公告       | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 1 月 19 日 |
| 2  | 国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 1 月 20 日 |
| 3  | 国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安                                              | 上证报、证监会规定        | 2026 年 1        |

|   |                                                         |                  |                 |
|---|---------------------------------------------------------|------------------|-----------------|
|   | 保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告           | 网站及公司网站          | 月 21 日          |
| 4 | 关于国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 2 月 11 日 |
| 5 | 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告          | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 2 月 27 日 |
| 6 | 关于国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 4 月 1 日  |
| 7 | 国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理变更公告                  | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 4 月 8 日  |
| 8 | 关于国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 4 月 28 日 |
| 9 | 关于国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 上证报、证监会规定网站及公司网站 | 2026 年 6 月 16 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              | 20260109~20260210       | -    | 9,647,853.35 | 9,647,853.35 | -          | -        |
| 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> |                |                         |      |              |              |            |          |

### 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中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》



12.1.3 《国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 报告期内国寿安保中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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](http://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