

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
2015 年年度报告

2015 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告	38
8.1 期末基金资产组合情况.....	38
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	46

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	48
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	48
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.13 投资组合报告附注	49
§9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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的情况	50
§10 开放式基金份额变动	50
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	52
§12 影响投资者决策的其他重要信息	55
§13 备查文件目录	55
13.1 备查文件目录	55
13.2 存放地点	55
13.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	国寿安保中证 500ETF 联接
基金主代码	001241
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	365,429,862.24 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510560
基金运作方式	契约型开放式（ETF）
基金合同生效日	2015年5月29日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年7月3日
基金管理人名称	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即中证 500 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金联接基金，跟踪中证 500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险、高预期收益的开放式基金。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。

业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬	林葛
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		100033	100031
法定代表人		刘慧敏	刘士余

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
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	2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-153,033,812.97
本期利润	-129,864,296.72
加权平均基金份额本期利润	-0.3397
本期加权平均净值利润率	-47.23%

本期基金份额净值增长率	-30.87%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-146,138,414.99
期末可供分配基金份额利润	-0.3999
期末基金资产净值	252,618,349.78
期末基金份额净值	0.6913
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-30.87%

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。

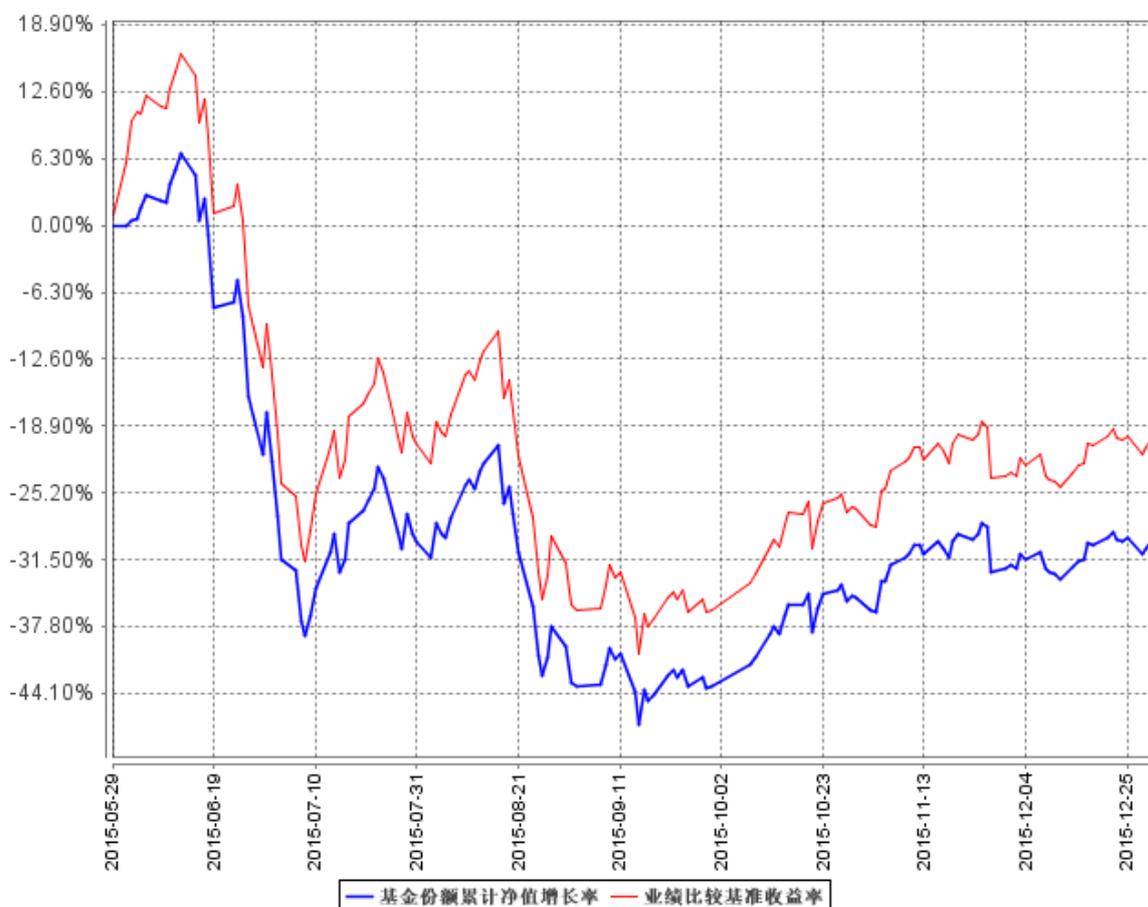
3.2 基金净值表现

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	22.35%	1.86%	23.13%	1.94%	-0.78%	-0.08%
过去六个月	-16.01%	2.96%	-13.51%	3.07%	-2.50%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-30.87%	3.01%	-21.49%	3.13%	-9.38%	-0.12%

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

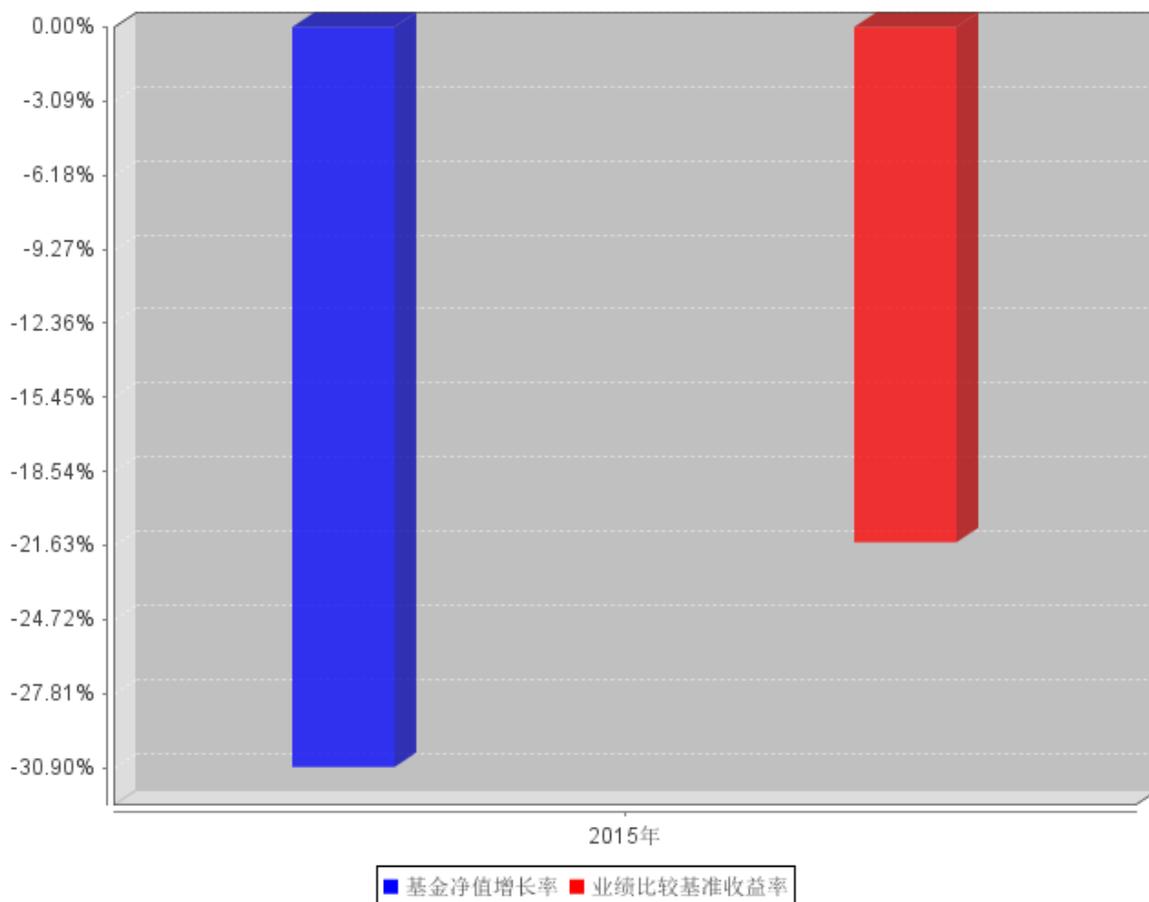
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 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 2015 年 5 月 29 日至 2015 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

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

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5.88亿元人民币,公司股东为中国人寿资产管理有限公司,持有股份85.03%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(澳大利亚安保资本投资有限公司),持有股份14.97%。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司共管理 18 只开放式基金及若干专户，公司管理资产总规模为 699.60 亿元，其中公募基金管理规模 570.03 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	5 年	李康先生，博士研究生。2009 年 10 月至 2012 年 12 月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及国寿安保中证 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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长期停牌股票引起的成份股权重偏离以及持有部分股票逐步换购为目标 ETF 份额引起的偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.6913 元，累计份额净值为 0.6913 元。报告期内净值增长率为-30.87%，同期业绩基准涨幅为-21.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2016 年，宏观经济基本面仍然处于探底阶段，经济转型和改革是驱动市场的主要因素，改革进展将直接影响投资者的信心。货币政策稳健偏宽松，但边际效用降低。整体是存量资金博弈的行情，未来市场将以结构性的投资机会为主。

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金将严守基金合同及相关法律法规，秉承指数化投资管理策略，以量化分析为基础不断优化改进投资方案，力争将相对标的指数业绩基准的跟踪误差降低

到最小程度。

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公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任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债券品种的估值数据。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-国寿安保基金管理有限公司 2015 年 5 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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(2016)审字第 61090605_A10 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	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资

	基金联接基金的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表,2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国寿安保基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)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而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,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。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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>	
审计意见段	我们认为,上述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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	辜虹	郭燕
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)	
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	2016 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 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

报告截止日: 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	7.4.7.1	14,997,459.70

结算备付金		11,270.34
存出保证金		294,914.52
交易性金融资产	7.4.7.2	237,514,508.21
其中：股票投资		7,280,473.23
基金投资		230,234,034.98
债券投资		-
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		-
应收利息	7.4.7.5	3,257.48
应收股利		-
应收申购款		99,804.72
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		252,921,214.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债：		
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		102,113.50
应付管理人报酬		10,213.29
应付托管费		2,042.68
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	18,110.90
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	170,384.82
负债合计		302,865.19
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	365,429,862.24
未分配利润	7.4.7.10	-112,811,512.46
所有者权益合计		252,618,349.78
负债和所有者权益总计		252,921,214.97

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.6913 元，基金份额总额 252,618,349.78 份。

7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-128,399,290.86
1.利息收入		201,143.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	186,015.97
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		15,127.80
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-151,835,641.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-152,563,939.84
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-
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	728,298.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	23,169,516.25
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	65,690.24
减：二、费用		1,465,005.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	425,149.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	85,029.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	718,938.61
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.21	235,887.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-129,864,296.72
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-129,864,296.72

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 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）	412,943,746.75	-	412,943,746.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-129,864,296.72	-129,864,296.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-47,513,884.51	17,052,784.26	-30,461,100.25
其中：1.基金申购款	31,668,930.16	-9,579,589.45	22,089,340.71
2.基金赎回款	-79,182,814.67	26,632,373.71	-52,550,440.96
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）	365,429,862.24	-112,811,512.46	252,618,349.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]485 号文《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于 2015 年 5 月 4 日至 2015 年 5 月 15 日向社会公开发行人募集，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(2015)验字第 61090605_A03 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 2015 年 5 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 412,943,746.75 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和注册登

记机构为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债，证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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〈年度报告和半年度报告〉》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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止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。本基金的报告期间为 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

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股票投资、基金投资、债券投资。

(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，或该金融资产已转移，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) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易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；

卖出债券于交易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；

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的目标 ETF 份额以其当日份额净值估值，当日无份额净值的，以最近工作日的份额净值估值，本基金持有的其他品种金融工具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市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只

有在可观察输入值无法取得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金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当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红利再投资、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) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 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；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.5% 年费率计提；

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.1% 的年费率计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。

(3) 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；

(4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金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；

(5) 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

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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；

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

7.4.6.2 营业税、企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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

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[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 2015 年 12 月 31 日
活期存款	14,997,459.70
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	14,997,459.70

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	9,990,098.67	7,280,473.23	-2,709,625.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	204,354,893.29	230,234,034.98	25,879,141.69
其他	-	-	-
合计	214,344,991.96	237,514,508.21	23,169,516.25

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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,105.90
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	5.61
应收债券利息	-
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	-
其他	145.97
合计	3,257.48

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

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	18,110.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,110.90

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	384.82
预提费用	170,000.00
合计	170,384.82

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	412,943,746.75	412,943,746.75
本期申购	31,668,930.16	31,668,930.16

本期赎回(以“-”号填列)	-79,182,814.67	-79,182,814.67
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	365,429,862.24	365,429,862.24

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；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	-153,033,812.97	23,169,516.25	-129,864,296.72
本期基金份额交易产生的变动数	6,895,397.98	10,157,386.28	17,052,784.26
其中：基金申购款	-5,710,537.21	-3,869,052.24	-9,579,589.45
基金赎回款	12,605,935.19	14,026,438.52	26,632,373.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-146,138,414.99	33,326,902.53	-112,811,512.46

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
活期存款利息收入	177,025.35
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	7,530.42
其他	1,460.20
合计	186,015.97

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

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-99,804,354.36
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-52,759,585.48
合计	-152,563,939.84

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
卖出股票成交总额	193,305,445.82
减：卖出股票成本总额	293,109,800.18
买卖股票差价收入	-99,804,354.36

7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
申购基金份额总额	192,121,400.00
减：现金支付申购款总额	103,666,374.08
减：申购股票成本总额	141,214,611.40
申购差价收入	-52,759,585.48

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期间无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期间无债券投资收益。

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具产生的收益。

7.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	728,298.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	728,298.72

7.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	23,169,516.25
——股票投资	-2,709,625.44
——债券投资	-
——基金投资	25,879,141.69
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	23,169,516.25

7.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
基金赎回费收入	63,177.66
转换费收入	2,512.58
合计	65,690.24

7.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
交易所市场交易费用	718,938.61
银行间市场交易费用	-
合计	718,938.61

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	180,000.00
银行费用	5,487.60

其他	400.00
合计	235,887.60

7.4.7.23 分部报告

无。

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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	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（“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”）	国寿资产的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

无。

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
	2015年5月29日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	425,149.66
其中：支付销售机构的客户维护费	286,815.72

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扣除本基金投

资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	85,029.99

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扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
集团公司	133,785,891.07	36.61%

7.4.10.5 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 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	14,997,459.70	177,025.35

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 147,463,034.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 43.08%。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2015 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值 单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大事项	24.68	2016 年 3 月 10 日	31.39	46,200	1,711,039.48	1,140,216.00	-
002018	华信国际	2015 年 6 月 15 日	重大事项	30.62	-	-	35,500	1,333,593.94	1,087,010.00	-
000066	长城电脑	2015 年 6 月 18 日	重大事项	15.19	2016 年 3 月 10 日	19.39	46,900	1,026,601.84	712,411.00	-
002219	恒康医疗	2015 年 7 月 8 日	重大资产重组	14.90	-	-	42,750	718,386.27	636,975.00	-
600978	宜华木业	2015 年 6 月 18 日	重大资产重组	22.33	2016 年 1 月 21 日	20.10	22,000	466,210.49	491,260.00	-
002174	游族网络	2015 年 7 月 23 日	重大资产重组	89.53	2016 年 2 月 15 日	80.58	3,100	414,900.90	277,543.00	-
600759	洲际油气	2015 年 9 月 21 日	重大资产重组	7.85	-	-	18,030	257,937.20	141,535.50	-
600219	南山铝业	2015 年 9 月 29 日	重大事项	6.58	2016 年 1 月 25 日	7.00	11,800	148,863.07	77,644.00	-
600880	博瑞传播	2015 年 9 月 16 日	重大资产重组	7.50	2016 年 1 月 18 日	8.25	9,000	212,479.22	67,500.00	-
600429	三元股份	2015 年 9 月 21 日	重大事项	7.29	2016 年 1 月 27 日	7.49	8,700	124,384.39	63,423.00	-

600572	康恩贝	2015 年 12 月 30 日	重大事项	13.36	2016 年 1 月 4 日	13.18	4,100	71,648.09	54,776.00	-
600120	浙江东方	2015 年 10 月 12 日	重大资产重组	19.86	-	-	2,300	104,853.42	45,678.00	-
601000	唐山港	2015 年 10 月 29 日	重大资产重组	8.25	2016 年 2 月 17 日	7.98	4,000	58,284.20	33,000.00	-
600864	哈投股份	2015 年 10 月 9 日	重大事项	10.88	2016 年 1 月 14 日	11.97	2,800	64,163.21	30,464.00	-
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大收购	12.22	-	-	1,700	15,470.00	20,774.00	-
000028	国药一致	2015 年 10 月 21 日	重大事项	66.15	2016 年 3 月 25 日	63.05	300	17,256.00	19,845.00	-
600729	重庆百货	2015 年 7 月 24 日	重大资产重组	32.39	2016 年 1 月 4 日	29.90	600	25,038.67	19,434.00	-
600122	宏图高科	2015 年 12 月 25 日	重大事项	19.42	-	-	796	15,177.96	15,458.32	-
600654	中安消	2015 年 12 月 14 日	重大事项	28.84	-	-	500	19,961.67	14,420.00	-
600584	长电科技	2015 年 11 月 30 日	重大资产重组	22.02	-	-	600	17,147.39	13,212.00	-
600645	中源协和	2015 年 12 月 30 日	重要事项	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	200	10,861.74	13,002.00	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大资产重组	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	400	20,782.18	12,500.00	-
600200	江苏吴中	2015 年 11 月 26 日	重大资产重组	27.89	2016 年 3 月 16 日	25.10	400	15,082.28	11,156.00	-
000426	兴业矿业	2015 年 10 月 28 日	重大资产重组	7.06	2016 年 3 月 21 日	7.77	1,500	12,783.02	10,590.00	-
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项	19.28	2016 年 1 月 11 日	23.33	500	9,940.00	9,640.00	-
600851	海欣股份	2015 年 12 月 21 日	重大事项	14.70	2016 年 1 月 19 日	13.23	600	9,838.40	8,820.00	-
600859	王府井	2015 年 12 月 21 日	重大事项	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	200	7,018.69	5,444.00	-
601717	郑煤机	2015 年 12 月 18 日	重大事项	7.52	-	-	700	11,054.57	5,264.00	-
601678	滨化股份	2015 年 12 月 31 日	重大事项	8.02	2016 年 1 月 5 日	7.22	500	5,413.52	4,010.00	-
002698	博实股份	2015 年 12 月 28 日	重大事项	29.33	2016 年 1 月 5 日	27.12	90	3,886.92	2,639.70	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

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、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；本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所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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

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、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下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。

单位：人民币元

本期末 2015 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	14,997,459.70	-	-	-	14,997,459.70
结算备付金	11,270.34	-	-	-	11,270.34
存出保证金	294,914.52	-	-	-	294,914.52
交易性金融资产	-	-	-	237,514,508.21	237,514,508.21
应收利息	-	-	-	3,257.48	3,257.48
应收申购款	-	-	-	99,804.72	99,804.72
资产总计	15,303,644.56	-	-	237,617,570.41	252,921,214.97
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	102,113.50	102,113.50
应付管理人报酬	-	-	-	10,213.29	10,213.29
应付托管费	-	-	-	2,042.68	2,042.68
应付交易费用	-	-	-	18,110.90	18,110.90
其他负债	-	-	-	170,384.82	170,384.82
负债总计	-	-	-	302,865.19	302,865.19
利率敏感度缺口	15,303,644.56	-	-	237,314,705.22	252,618,349.78

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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和中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，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。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于 2015 年 12 月 31 日，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 2015 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	7,280,473.23	2.88
交易性金融资产-基金投资	230,234,034.98	91.14
交易性金融资产-债券投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	237,514,508.21	94.02

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是自基金合同生效日至 2015 年 12 月 31 日所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2015 年 12 月 31 日）
	+5%	11,365,094.05
	-5%	-11,365,094.05

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 235,408,500.69 元，属于第二层次的余额为人民币 2,106,007.52 元，无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

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 2016 年 3 月 25 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	7,280,473.23	2.88
	其中：股票	7,280,473.23	2.88
2	基金投资	230,234,034.98	91.03
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	15,008,730.04	5.93
8	其他各项资产	397,976.72	0.16
9	合计	252,921,214.97	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	123,850.00	0.05
C	制造业	5,700,672.25	2.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,836.85	0.03
E	建筑业	43,549.75	0.02
F	批发和零售业	386,319.94	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	122,640.53	0.05
H	住宿和餐饮业	5,132.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	344,638.62	0.14
J	金融业	46,704.00	0.02
K	房地产业	261,750.03	0.10
L	租赁和商务服务业	19,704.20	0.01
M	科学研究和技术服务业	16,164.50	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	20,685.60	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,755.16	0.00
R	文化、体育和娱乐业	88,595.00	0.04
S	综合	24,474.80	0.01
	合计	7,280,473.23	2.88

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000748	长城信息	46,200	1,140,216.00	0.45
2	002018	华信国际	35,500	1,087,010.00	0.43
3	000066	长城电脑	46,900	712,411.00	0.28
4	002219	恒康医疗	42,750	636,975.00	0.25
5	600978	宜华木业	22,000	491,260.00	0.19
6	002384	东山精密	24,000	480,480.00	0.19
7	002174	游族网络	3,100	277,543.00	0.11
8	600736	苏州高新	16,300	179,300.00	0.07
9	600759	洲际油气	18,030	141,535.50	0.06
10	600259	广晟有色	2,400	95,040.00	0.04
11	600219	南山铝业	11,800	77,644.00	0.03
12	600880	博瑞传播	9,000	67,500.00	0.03

13	600651	飞乐音响	4,400	64,900.00	0.03
14	600429	三元股份	8,700	63,423.00	0.03
15	600572	康恩贝	4,100	54,776.00	0.02
16	600120	浙江东方	2,300	45,678.00	0.02
17	601000	唐山港	4,000	33,000.00	0.01
18	600643	爱建股份	2,100	30,765.00	0.01
19	600864	哈投股份	2,800	30,464.00	0.01
20	600366	宁波韵升	1,300	28,392.00	0.01
21	600026	中海发展	2,400	22,176.00	0.01
22	000519	江南红箭	1,260	21,394.80	0.01
23	000829	天音控股	1,700	20,774.00	0.01
24	000028	国药一致	300	19,845.00	0.01
25	600729	重庆百货	600	19,434.00	0.01
26	600528	中铁二局	1,300	18,629.00	0.01
27	300134	大富科技	600	18,060.00	0.01
28	600436	片仔癀	250	17,197.50	0.01
29	600160	巨化股份	709	16,640.23	0.01
30	002672	东江环保	800	16,136.00	0.01
31	600816	安信信托	700	15,939.00	0.01
32	600058	五矿发展	700	15,890.00	0.01
33	600079	人福医药	700	15,582.00	0.01
34	600122	宏图高科	796	15,458.32	0.01
35	600428	中远航运	1,500	15,390.00	0.01
36	600525	长园集团	800	15,064.00	0.01
37	600635	大众公用	1,500	14,790.00	0.01
38	600201	金宇集团	400	14,788.00	0.01
39	600654	中安消	500	14,420.00	0.01
40	600482	风帆股份	300	14,115.00	0.01
41	600410	华胜天成	500	13,255.00	0.01
42	600584	长电科技	600	13,212.00	0.01
43	600158	中体产业	500	13,040.00	0.01
44	600645	中源协和	200	13,002.00	0.01
45	600655	豫园商城	800	12,928.00	0.01
46	600699	均胜电子	400	12,500.00	0.00
47	600522	中天科技	500	11,450.00	0.00
48	600498	烽火通信	400	11,404.00	0.00
49	600487	亨通光电	700	11,158.00	0.00
50	600200	江苏吴中	400	11,156.00	0.00
51	600770	综艺股份	600	10,962.00	0.00

52	600478	科力远	500	10,960.00	0.00
53	601012	隆基股份	800	10,920.00	0.00
54	600664	哈药股份	900	10,737.00	0.00
55	600879	航天电子	600	10,722.00	0.00
56	600594	益佰制药	500	10,600.00	0.00
57	000426	兴业矿业	1,500	10,590.00	0.00
58	600601	方正科技	1,700	10,506.00	0.00
59	600869	智慧能源	1,100	10,505.00	0.00
60	600694	大商股份	200	10,326.00	0.00
61	600143	金发科技	1,200	10,320.00	0.00
62	600500	中化国际	800	10,248.00	0.00
63	600521	华海药业	400	10,156.00	0.00
64	600881	亚泰集团	1,400	10,136.00	0.00
65	600376	首开股份	800	10,000.00	0.00
66	600312	平高电气	500	9,750.00	0.00
67	002371	七星电子	500	9,640.00	0.00
68	603077	和邦股份	1,400	9,422.00	0.00
69	600872	中炬高新	600	9,390.00	0.00
70	600138	中青旅	400	9,324.00	0.00
71	600611	大众交通	600	9,210.00	0.00
72	600673	东阳光科	900	9,171.00	0.00
73	603019	中科曙光	100	9,117.00	0.00
74	600499	科达洁能	400	9,052.00	0.00
75	600240	华业地产	600	9,030.00	0.00
76	600835	上海机电	296	8,971.76	0.00
77	002238	天威视讯	400	8,880.00	0.00
78	600851	海欣股份	600	8,820.00	0.00
79	600704	物产中大	500	8,810.00	0.00
80	600418	江淮汽车	600	8,754.00	0.00
81	600811	东方集团	1,000	8,680.00	0.00
82	600435	北方导航	301	8,638.70	0.00
83	600797	浙大网新	600	8,628.00	0.00
84	600171	上海贝岭	400	8,476.00	0.00
85	600755	厦门国贸	900	8,388.00	0.00
86	600325	华发股份	500	8,150.00	0.00
87	600270	外运发展	300	8,118.00	0.00
88	600422	昆药集团	200	7,964.00	0.00
89	600183	生益科技	800	7,912.00	0.00
90	600765	中航重机	400	7,856.00	0.00

91	600884	杉杉股份	200	7,848.00	0.00
91	600017	日照港	1,200	7,848.00	0.00
92	600320	振华重工	1,300	7,761.00	0.00
93	600176	中国巨石	300	7,623.00	0.00
94	600517	置信电气	600	7,596.00	0.00
95	600511	国药股份	200	7,584.00	0.00
96	600064	南京高科	400	7,580.00	0.00
97	600557	康缘药业	300	7,506.00	0.00
98	600169	太原重工	1,300	7,462.00	0.00
99	600198	大唐电信	300	7,401.00	0.00
100	600805	悦达投资	580	7,342.80	0.00
101	600587	新华医疗	200	7,266.00	0.00
102	600536	中国软件	200	7,216.00	0.00
103	600426	华鲁恒升	500	7,215.00	0.00
104	603766	隆鑫通用	300	7,119.00	0.00
105	600787	中储股份	700	7,028.00	0.00
106	600067	冠城大通	800	6,992.00	0.00
107	600161	天坛生物	200	6,986.00	0.00
108	600380	健康元	500	6,910.00	0.00
109	600826	兰生股份	200	6,888.00	0.00
110	600433	冠豪高新	600	6,876.00	0.00
111	600062	华润双鹤	300	6,843.00	0.00
112	600187	国中水务	1,100	6,831.00	0.00
113	600056	中国医药	400	6,652.00	0.00
114	601311	骆驼股份	300	6,549.00	0.00
115	600175	美都能源	900	6,507.00	0.00
116	600125	铁龙物流	700	6,433.00	0.00
117	600267	海正药业	400	6,340.00	0.00
118	600220	江苏阳光	1,100	6,314.00	0.00
119	600351	亚宝药业	400	6,248.00	0.00
120	600416	湘电股份	300	6,219.00	0.00
121	600546	山煤国际	1,400	6,202.00	0.00
122	600216	浙江医药	500	6,185.00	0.00
123	600580	卧龙电气	400	6,168.00	0.00
124	600993	马应龙	280	6,165.60	0.00
125	600086	东方金钰	500	6,155.00	0.00
126	600894	广日股份	300	5,997.00	0.00
127	600885	宏发股份	200	5,978.00	0.00
128	600260	凯乐科技	400	5,976.00	0.00

129	600289	亿阳信通	300	5,910.00	0.00
130	600614	鼎立股份	500	5,815.00	0.00
131	600808	马钢股份	1,800	5,670.00	0.00
132	600073	上海梅林	400	5,660.00	0.00
133	600039	四川路桥	1,102	5,620.20	0.00
134	600566	济川药业	200	5,532.00	0.00
135	600757	长江传媒	500	5,490.00	0.00
136	600284	浦东建设	400	5,476.00	0.00
137	600859	王府井	200	5,444.00	0.00
138	600481	双良节能	600	5,436.00	0.00
139	600628	新世界	300	5,427.00	0.00
140	600409	三友化工	700	5,425.00	0.00
141	600006	东风汽车	601	5,324.86	0.00
142	600458	时代新材	300	5,310.00	0.00
142	600460	士兰微	600	5,310.00	0.00
143	601717	郑煤机	700	5,264.00	0.00
144	601777	力帆股份	300	5,202.00	0.00
145	600812	华北制药	600	5,166.00	0.00
146	600850	华东电脑	100	5,165.00	0.00
147	600754	锦江股份	100	5,132.00	0.00
148	600112	天成控股	300	5,028.00	0.00
149	600823	世茂股份	400	4,892.00	0.00
150	600586	金晶科技	800	4,888.00	0.00
151	600790	轻纺城	600	4,878.00	0.00
152	600970	中材国际	400	4,780.00	0.00
153	600825	新华传媒	400	4,776.00	0.00
154	601880	大连港	800	4,768.00	0.00
155	600831	广电网络	300	4,743.00	0.00
156	600337	美克家居	300	4,686.00	0.00
157	601002	晋亿实业	400	4,612.00	0.00
158	600551	时代出版	200	4,550.00	0.00
158	601139	深圳燃气	500	4,550.00	0.00
159	600292	中电远达	220	4,549.60	0.00
160	600251	冠农股份	400	4,520.00	0.00
161	600639	浦东金桥	200	4,478.00	0.00
162	600545	新疆城建	400	4,428.00	0.00
163	600180	瑞茂通	200	4,416.00	0.00
164	600720	祁连山	500	4,415.00	0.00
165	600059	古越龙山	400	4,396.00	0.00

166	601369	陕鼓动力	500	4,370.00	0.00
167	603699	纽威股份	200	4,364.00	0.00
168	600575	皖江物流	700	4,333.00	0.00
169	600300	维维股份	600	4,302.00	0.00
170	600004	白云机场	300	4,269.00	0.00
171	600640	号百控股	200	4,242.00	0.00
172	600329	中新药业	200	4,236.00	0.00
173	600496	精工钢构	700	4,207.00	0.00
174	601666	平煤股份	900	4,194.00	0.00
175	600563	法拉电子	100	4,161.00	0.00
176	601908	京运通	500	4,110.00	0.00
177	600596	新安股份	400	4,080.00	0.00
178	600456	宝钛股份	200	4,060.00	0.00
179	600748	上实发展	300	4,026.00	0.00
180	601678	滨化股份	500	4,010.00	0.00
181	600761	安徽合力	300	4,005.00	0.00
182	601126	四方股份	300	3,984.00	0.00
183	601233	桐昆股份	300	3,945.00	0.00
184	600509	天富能源	400	3,924.00	0.00
185	601886	江河创建	300	3,783.00	0.00
186	300244	迪安诊断	54	3,755.16	0.00
187	600773	西藏城投	200	3,640.00	0.00
188	603555	贵人鸟	100	3,543.00	0.00
189	600750	江中药业	100	3,529.00	0.00
190	600657	信达地产	500	3,475.00	0.00
191	600776	东方通信	300	3,432.00	0.00
192	603001	奥康国际	100	3,362.00	0.00
193	600280	中央商场	300	3,351.00	0.00
194	601001	大同煤业	600	3,330.00	0.00
195	601515	东风股份	200	3,316.00	0.00
196	600395	盘江股份	400	3,284.00	0.00
197	601801	皖新传媒	100	3,268.00	0.00
198	600618	氯碱化工	200	3,228.00	0.00
199	600132	重庆啤酒	200	3,198.00	0.00
200	600803	新奥股份	200	3,172.00	0.00
201	600874	创业环保	300	3,165.00	0.00
202	601226	华电重工	250	3,162.50	0.00
203	601101	昊华能源	400	3,144.00	0.00
204	600617	国新能源	200	3,066.00	0.00

205	600298	安琪酵母	100	3,042.00	0.00
206	600088	中视传媒	100	3,011.00	0.00
207	600537	亿晶光电	200	2,996.00	0.00
208	601005	重庆钢铁	900	2,961.00	0.00
209	603328	依顿电子	100	2,951.00	0.00
210	600141	兴发集团	200	2,924.00	0.00
211	601010	文峰股份	400	2,908.00	0.00
212	600184	光电股份	100	2,891.00	0.00
213	600997	开滦股份	500	2,790.00	0.00
214	600743	华远地产	400	2,712.00	0.00
215	002698	博实股份	90	2,639.70	0.00
216	600971	恒源煤电	400	2,516.00	0.00
217	600468	百利电气	140	2,480.80	0.00
218	002030	达安基因	60	2,470.80	0.00
219	600507	方大特钢	400	2,440.00	0.00
220	600510	黑牡丹	200	2,406.00	0.00
221	600425	青松建化	400	2,336.00	0.00
222	603188	亚邦股份	100	2,238.00	0.00
223	600780	通宝能源	300	2,127.00	0.00
224	603366	日出东方	200	2,120.00	0.00
225	002588	史丹利	60	1,951.80	0.00
226	601965	中国汽研	200	1,878.00	0.00
227	600335	国机汽车	100	1,874.00	0.00
228	603169	兰石重装	100	1,825.00	0.00
229	600397	安源煤业	300	1,752.00	0.00
230	600917	重庆燃气	100	1,519.00	0.00
231	000685	中山公用	99	1,400.85	0.00
232	000078	海王生物	57	1,365.72	0.00
233	002551	尚荣医疗	38	1,252.86	0.00
234	002325	洪涛股份	75	1,172.25	0.00
235	002311	海大集团	80	1,117.60	0.00
236	300273	和佳股份	50	1,045.00	0.00
237	002025	航天电器	40	1,039.60	0.00
238	000997	新大陆	40	1,012.80	0.00
239	002285	世联行	61	990.03	0.00
240	002181	粤传媒	60	951.00	0.00
241	000511	烯碳新材	80	936.80	0.00
242	000418	小天鹅A	39	936.00	0.00
243	000860	顺鑫农业	42	894.60	0.00

244	002681	奋达科技	20	874.00	0.00
245	300253	卫宁软件	20	837.60	0.00
246	002595	豪迈科技	36	816.84	0.00
247	600801	华新水泥	100	815.00	0.00
248	002408	齐翔腾达	55	732.05	0.00
249	000718	苏宁环球	50	659.50	0.00
250	002266	浙富控股	80	651.20	0.00
251	002254	泰和新材	40	635.60	0.00
252	002204	大连重工	59	590.00	0.00
253	002665	首航节能	18	549.00	0.00
254	000541	佛山照明	30	501.00	0.00
255	002063	远光软件	23	486.22	0.00
256	002013	中航机电	20	453.20	0.00
257	002092	中泰化学	36	316.80	0.00
258	000861	海印股份	40	309.20	0.00
259	000732	泰禾集团	12	294.00	0.00
260	002277	友阿股份	20	277.80	0.00
261	002140	东华科技	11	234.30	0.00
262	002440	闰土股份	11	209.55	0.00
263	002251	步步高	10	163.00	0.00
264	000572	海马汽车	14	89.60	0.00
265	000897	津滨发展	15	85.50	0.00
266	000582	北部湾港	3	67.53	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	7,822,673.00	3.10
2	300168	万达信息	3,664,838.60	1.45
3	601099	太平洋	2,930,054.00	1.16
4	600446	金证股份	2,493,127.00	0.99
5	600820	隧道股份	2,279,772.00	0.90
6	600635	大众公用	2,242,644.50	0.89
7	600037	歌华有线	2,193,687.50	0.87
8	002030	达安基因	2,166,690.00	0.86
9	600601	方正科技	2,155,651.00	0.85

10	600219	南山铝业	2,123,191.00	0.84
11	300253	卫宁软件	2,079,193.00	0.82
12	300033	同花顺	2,057,129.00	0.81
13	600525	长园集团	2,049,578.00	0.81
14	600881	亚泰集团	2,001,266.00	0.79
15	600895	张江高科	1,948,796.34	0.77
16	600654	中安消	1,900,351.00	0.75
17	000540	中天城投	1,897,690.00	0.75
18	600978	宜华木业	1,864,842.00	0.74
19	600143	金发科技	1,860,967.00	0.74
20	000592	平潭发展	1,860,700.00	0.74

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300059	东方财富	7,180,109.00	2.84
2	300168	万达信息	3,767,658.60	1.49
3	601099	太平洋	2,965,497.43	1.17
4	600820	隧道股份	2,366,096.00	0.94
5	601519	大智慧	1,640,657.00	0.65
6	000977	浪潮信息	1,559,636.00	0.62
7	000712	锦龙股份	1,444,404.00	0.57
8	601872	招商轮船	1,399,599.00	0.55
9	600490	鹏欣资源	1,327,754.00	0.53
10	000012	南玻A	1,222,855.00	0.48
11	600266	北京城建	1,206,702.00	0.48
12	000566	海南海药	1,186,952.00	0.47
13	600098	广州发展	1,125,070.00	0.45
14	000540	中天城投	1,105,657.00	0.44
15	300253	卫宁软件	1,096,636.00	0.43
16	000998	隆平高科	1,087,733.00	0.43
17	600317	营口港	1,086,051.00	0.43
18	002030	达安基因	1,070,826.80	0.42
19	002690	美亚光电	1,069,878.56	0.42

20	300033	同花顺	1,060,709.00	0.42
----	--------	-----	--------------	------

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	444,314,510.25
卖出股票收入（成交）总额	193,305,445.82

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国寿安保中证 500ETF	股票型	交易型开放式	国寿安保基金管理有限公司	230,234,034.98	91.14

8.11 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合约。

8.12 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合约。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内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中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	294,914.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,257.48
5	应收申购款	99,804.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	397,976.72

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000748	长城信息	1,140,216.00	0.45	公告重大事项
2	002018	华信国际	1,087,010.00	0.43	公告重大事项
3	000066	长城电脑	712,411.00	0.28	公告重大事项
4	002219	恒康医疗	636,975.00	0.25	公告重大事项
5	600978	宜华木业	491,260.00	0.19	公告重大事项
6	002174	游族网络	277,543.00	0.11	公告重大事项
7	600759	洲际油气	141,535.50	0.06	公告重大事项

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
5,959	61,324.02	134,687,165.33	36.86%	230,742,696.91	63.14%

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	1,602.64	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的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发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（2015年5月29日）基金份额总额	412,943,746.75
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	31,668,930.16
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	79,182,814.67
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	365,429,862.24

§ 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 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	352,849,660.69	55.34%	251,659.08	55.34%	新增
申万宏源	1	284,770,295.38	44.66%	202,995.69	44.66%	新增

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，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

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

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

(7)从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	140,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 4 月 30 日
2	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基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 4 月 30 日
3	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招募说明书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 4 月 30 日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金新增销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 5 月 6 日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金新增销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 5 月 12 日
6	国寿安保基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 5 月 25 日

7	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基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 5 月 30 日
8	国寿安保基金管理有限公司办公地址变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 6 月 8 日
9	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开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 6 月 30 日
10	国寿安保基金管理有限公司关于调整纸质对账单服务形式的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 1 日
11	国寿安保基金管理有限公司关于公司、管理层及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 6 日
12	国寿安保基金管理有限公司关于开展直销中心申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 7 日
13	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金开展直销中心赎回费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 7 日
14	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 8 日
15	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 9 日
16	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 7 月 10 日
17	国寿安保基金管理有限公司关于新增上海联泰、新兰德和泰诚财富为基金销售机构并开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 8 月 13 日
18	国寿安保基金管理有限公司关于中信证券股份有限公司吸收合并中信证券（浙江）有限责任公司涉及相关基金业务影响的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 8 月 13 日
19	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参与数米基金费率	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 8 月 14 日

	优惠活动的公告		
20	国寿安保基金管理有限公司关于开通天天基金定期定额申购业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 8 月 25 日
21	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 8 月 26 日
22	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 9 月 9 日
23	国寿安保基金管理有限公司关于调整数米基金申购金额下限的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 9 月 9 日
24	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 9 月 16 日
25	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金开展直销中心费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 9 月 17 日
26	国寿安保基金管理有限公司新增诺亚正行、上海汇付、富济财富为基金销售机构并开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 9 月 24 日
27	国寿安保基金管理有限公司新增北京乐融多源投资咨询有限公司为基金销售机构并开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 9 月 30 日
28	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 2015 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 10 月 26 日
29	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金开展直销费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 11 月 4 日
30	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增中国国际金融股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 12 月 24 日
31	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加众禄金融费率优惠活动及开通定期定额投资业务、基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 12 月 25 日
32	国寿安保基金管理有限公司新增上海陆金所资产管理有限公司为基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 12 月 28 日

33	国寿安保基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金开放时间调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2015 年 12 月 31 日
----	--------------------------------------	-----------------------------	------------------

§ 12 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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

13.1.2 《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基金合同》

13.1.3 《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 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金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.gsfunds.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
2016 年 3 月 28 日