

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
2016 年半年度报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 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。本半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 8 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未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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
§5 托管人报告	11
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	41
7.10 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.....	41
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41

7.13 投资组合报告附注.....	41
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 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	428,735,230.93 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
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
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	周慕冰

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,831,642.36
本期利润	-44,377,282.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1225
本期加权平均净值利润率	-22.13%
本期基金份额净值增长率	-17.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-184,295,093.66
期末可供分配基金份额利润	-0.4299

期末基金资产净值	244,440,137.27
期末基金份额净值	0.5701
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-42.99%

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

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

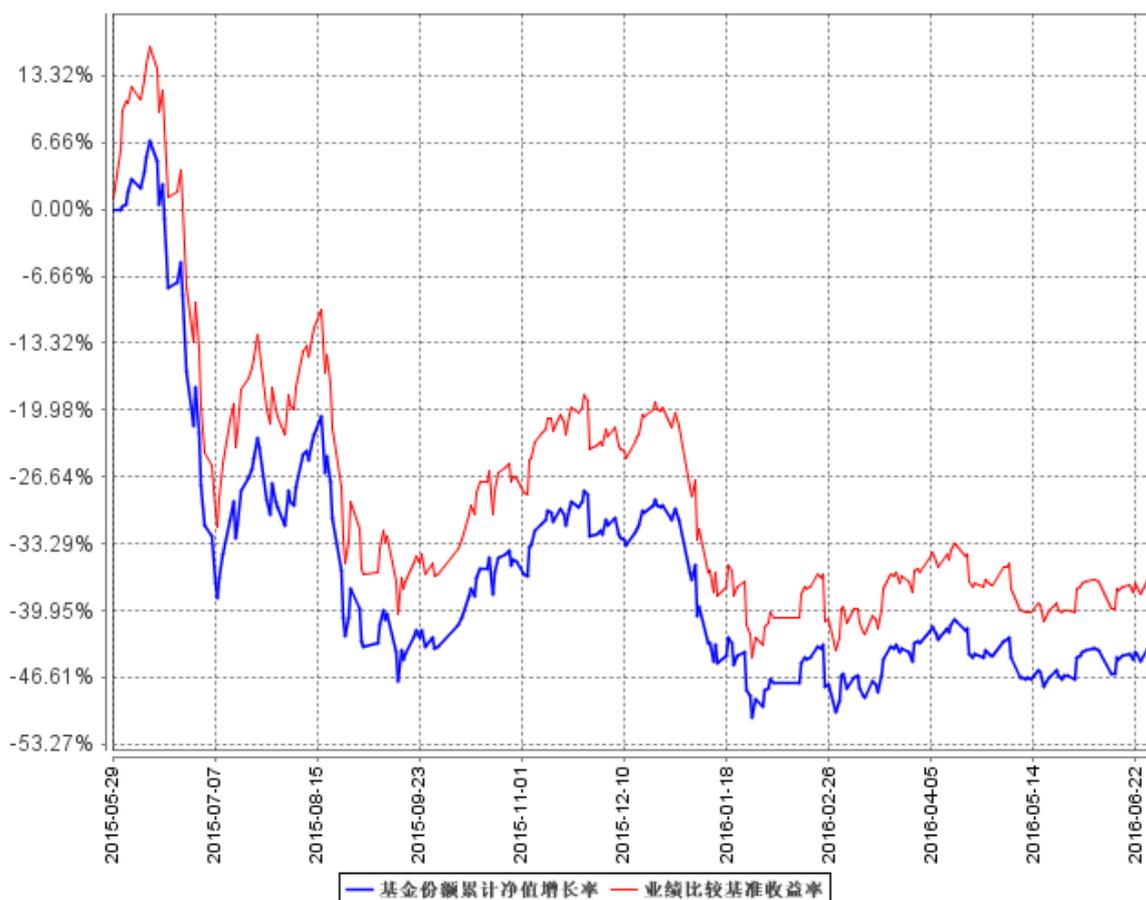
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.02%	1.43%	2.82%	1.47%	0.20%	-0.04%
过去三个月	-0.05%	1.53%	-0.45%	1.57%	0.40%	-0.04%
过去六个月	-17.53%	2.33%	-18.57%	2.43%	1.04%	-0.10%
过去一年	-30.74%	2.66%	-29.57%	2.77%	-1.17%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-42.99%	2.72%	-36.07%	2.83%	-6.92%	-0.11%

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 2016 年 6 月 30 日。

§ 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，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 21 只开放式基金和部分特定资产管理计划，

公司管理资产总规模为 788.64 亿元，其中公募基金管理规模 533.27 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	6 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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不

存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。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。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。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 0.5701 元，累计份额净值为 0.5701 元。报告期内净值增长率为-17.53%，同期业绩基准涨幅为-18.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年上半年股市经历了快速下跌和修复阶段，1 月受汇率波动和熔断制度影响快速下跌，随后逐渐震荡回升。年初至 6 月底，上证综指跌幅仍达约 17.23%。展望下半年，经济增长仍存在下行压力，财政与货币政策仍偏向积极，但空间相对有限。经济政策层面，需关注国企改革的推进，以及中央经济工作会议等。整体来看下半年 A 股市场出现大的趋势性行情概率较小，将以结构性行情为主。外围市场方面，美联储加息概率有所降低，12 月份的大选结果的影响值得关注。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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 托管人对本半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

半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 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	52,415,662.62	14,997,459.70
结算备付金		-	11,270.34
存出保证金		2,703.99	294,914.52
交易性金融资产	6.4.7.2	228,506,308.47	237,514,508.21
其中：股票投资		3,151,971.14	7,280,473.23
基金投资		225,354,337.33	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,128,759.44	-
应收利息	6.4.7.5	3,328.90	3,257.48
应收股利		-	-
应收申购款		1,018.78	99,804.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		283,057,782.20	252,921,214.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		38,212,819.39	-
应付赎回款		149,018.82	102,113.50
应付管理人报酬		6,293.68	10,213.29
应付托管费		1,258.75	2,042.68
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	13,651.57	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	6.4.7.8	234,602.72	170,384.82
负债合计		38,617,644.93	302,865.19
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	428,735,230.93	365,429,862.24
未分配利润	6.4.7.10	-184,295,093.66	-112,811,512.46
所有者权益合计		244,440,137.27	252,618,349.78
负债和所有者权益总计		283,057,782.20	252,921,214.97

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.5701 元，基金份额总额 428,735,230.93 份。

6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-44,133,006.18	-72,353,020.06
1.利息收入		50,614.89	121,967.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	50,614.89	106,839.91
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）		-2,648,422.71	2,512,849.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,654,522.60	2,010,525.33
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,099.89	502,324.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-41,545,640.34	-74,987,837.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	10,441.98	-

减：二、费用		244,276.52	714,483.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	42,560.46	177,049.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,512.14	35,409.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	18,041.50	465,213.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	175,162.42	36,810.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,377,282.70	-73,067,503.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,377,282.70	-73,067,503.07

6.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	365,429,862.24	-112,811,512.46	252,618,349.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-44,377,282.70	-44,377,282.70
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）	63,305,368.69	-27,106,298.50	36,199,070.19
其中：1. 基金申购款	78,327,502.16	-33,775,741.70	44,551,760.46
2. 基金赎回款	-15,022,133.47	6,669,443.20	-8,352,690.27
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）	428,735,230.93	-184,295,093.66	244,440,137.27
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-73,067,503.07	-73,067,503.07
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	412,943,746.75	-73,067,503.07	339,876,243.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	52,415,662.62
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	52,415,662.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,503,749.29	3,151,971.14	-1,351,778.15
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	242,378,683.27	225,354,337.33	-17,024,345.94
其他	-	-	-
合计	246,882,432.56	228,506,308.47	-18,376,124.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,327.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.20
合计	3,328.90

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	13,651.57

银行间市场应付交易费用	-
合计	13,651.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	561.58
预提费用	234,041.14
合计	234,602.72

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	365,429,862.24	365,429,862.24
本期申购	78,327,502.16	78,327,502.16
本期赎回(以“-”号填列)	-15,022,133.47	-15,022,133.47
- 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	428,735,230.93	428,735,230.93

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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-146,138,414.99	33,326,902.53	-112,811,512.46
本期利润	-2,831,642.36	-41,545,640.34	-44,377,282.70
本期基金份额交易产生的变动数	-25,725,086.02	-1,381,212.48	-27,106,298.50
其中：基金申购款	-31,795,577.87	-1,980,163.83	-33,775,741.70
基金赎回款	6,070,491.85	598,951.35	6,669,443.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-174,695,143.37	-9,599,950.29	-184,295,093.66

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日

活期存款利息收入	50,297.06
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	5.06
其他	312.77
合计	50,614.89

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,311,908.29
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-1,342,614.31
合计	-2,654,522.60

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	2,314,542.30
减：卖出股票成本总额	3,626,450.59
买卖股票差价收入	-1,311,908.29

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
申购基金份额总额	38,016,400.00
减：现金支付申购款总额	21,146,051.92
减：申购股票成本总额	18,212,962.39
申购差价收入	-1,342,614.31

6.4.7.13 基金投资收益

本基金于本报告期无买卖基金差价收益/损失。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金于本报告期无债券投资收益/损失。

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金于本报告期无买卖贵金属差价收益/损失。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,099.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,099.89

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-41,545,640.34
——股票投资	1,357,847.29
——债券投资	-
——基金投资	-42,903,487.63
——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	-41,545,640.34

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	9,800.65
转换费收入	641.33
合计	10,441.98

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	18,041.50
银行间市场交易费用	-
合计	18,041.50

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	149,178.12
银行费用	1,121.28
其他	-
合计	175,162.42

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、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
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	公司的最终控制人
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
国寿安保中证 500ETF（简称“目标基金”）	公司管理的其他基金

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	42,560.46	177,049.14
其中：支付销售机构的客户维护费	170,766.92	64,056.77

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）

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,512.14	35,409.83

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）

6.4.10.1.3 销售服务费

无。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.3.1 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。

6.4.10.4.2 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 2016年6月30日		上年度末 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	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	31.20%	133,785,891.07	36.61%

6.4.10.4 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至 2015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
农业银行	52,415,662.62	50,297.06	33,483,620.28	106,839.91

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 177,486,286.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 68.71%。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016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。

6.4.12.2 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
600759	洲际油气	2016年6月24日	公告重大事项	7.58	2016年7月11日	8.10	6,030	86,265.19	45,707.40	-
002672	东江环保	2016年6月21日	公告重大事项	17.33	2016年7月15日	19.06	800	23,259.64	13,864.00	-
000511	*ST 烯碳	2016年4月25日	公告重大事项	8.92	-	-	80	1,177.01	713.60	-
000718	苏宁环球	2016年5月6日	公告重大事项	13.09	2016年7月18日	11.78	50	777.76	654.50	-
002266	浙富控股	2016年5月24日	公告重大事项	5.35	-	-	80	1,195.05	428.00	-
000582	北部湾港	2016年6月6日	公告重大事项	16.32	-	-	3	51.02	48.96	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证

券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	52,415,662.62	-	-	-	52,415,662.62
存出保证金	2,703.99	-	-	-	2,703.99
交易性金融资产	-	-	-	228,506,308.47	228,506,308.47
应收证券清算款	-	-	-	2,128,759.44	2,128,759.44
应收利息	-	-	-	3,328.90	3,328.90
应收申购款	-	-	-	1,018.78	1,018.78
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,418,366.61	-	-	230,639,415.59	283,057,782.20
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	38,212,819.39	38,212,819.39
应付赎回款	-	-	-	149,018.82	149,018.82
应付管理人报酬	-	-	-	6,293.68	6,293.68
应付托管费	-	-	-	1,258.75	1,258.75
应付交易费用	-	-	-	13,651.57	13,651.57
其他负债	-	-	-	234,602.72	234,602.72
负债总计	-	-	-	38,617,644.93	38,617,644.93
利率敏感度缺口	52,418,366.61	-	-	192,021,770.66	244,440,137.27
上年度末 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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和中证 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 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,151,971.14	1.29	7,280,473.23	2.88
交易性金融资产-基金投资	225,354,337.33	92.19	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	228,506,308.47	93.48	237,514,508.21	94.02

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是自基金合同生效日至 2016 年 6 月 30 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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	+5%	12,578,448.18	11,365,094.05
	-5%	-12,578,448.18	-11,365,094.05

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

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

(1) 各层次金融工具公允价值

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 228,444,892.01 元，属于第二层次的余额为人民币 61,416.46 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。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 8 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,151,971.14	1.11
	其中：股票	3,151,971.14	1.11
2	基金投资	225,354,337.33	79.61
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	52,415,662.62	18.52
8	其他各项资产	2,135,811.11	0.75
9	合计	283,057,782.20	100.00

7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,555.00	0.00
B	采矿业	93,821.00	0.04
C	制造业	2,222,828.67	0.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,090.62	0.01
E	建筑业	22,192.96	0.01
F	批发和零售业	178,331.44	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	56,347.16	0.02
H	住宿和餐饮业	3,346.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	342,466.15	0.14
J	金融业	9,503.00	0.00
K	房地产业	93,906.98	0.04
L	租赁和商务服务业	11,353.20	0.00
M	科学研究和技术服务业	12,064.50	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,975.00	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	3,199.06	0.00
R	文化、体育和娱乐业	31,168.00	0.01

S	综合	16,822.40	0.01
	合计	3,151,971.14	1.29

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

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

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	906,444.00	0.37
2	002219	恒康医疗	42,750	472,387.50	0.19
3	002174	游族网络	9,300	297,600.00	0.12
4	600429	三元股份	8,400	65,772.00	0.03
5	600259	广晟有色	900	51,534.00	0.02
6	600759	洲际油气	6,030	45,707.40	0.02
7	000829	天音控股	1,700	22,695.00	0.01
8	002371	七星电子	500	20,910.00	0.01
9	002384	东山精密	1,000	19,860.00	0.01
10	000028	国药一致	300	19,530.00	0.01
11	300134	大富科技	600	17,976.00	0.01
12	000519	江南红箭	1,363	17,323.73	0.01
13	600584	长电科技	700	14,203.00	0.01
14	002672	东江环保	800	13,864.00	0.01
15	600880	博瑞传播	1,400	11,914.00	0.00
16	600522	DR 中天科	1,200	11,760.00	0.00
17	000426	兴业矿业	1,500	11,280.00	0.00
18	600201	生物股份	400	10,932.00	0.00
19	600521	华海药业	430	10,457.60	0.00
20	600219	南山铝业	1,400	10,360.00	0.00
21	600525	长园集团	740	10,249.00	0.00
22	600436	片仔癀	225	10,127.25	0.00
23	600503	华丽家族	1,100	10,087.00	0.00
24	600079	人福医药	600	10,062.00	0.00
25	600482	中国动力	300	9,831.00	0.00
26	600498	烽火通信	400	9,712.00	0.00
27	600879	航天电子	600	9,348.00	0.00
28	601012	隆基股份	700	9,135.00	0.00
29	600978	宜华生活	800	8,912.00	0.00

30	600158	中体产业	500	8,875.00	0.00
31	600682	南京新百	300	8,541.00	0.00
32	600664	哈药股份	1,030	8,538.70	0.00
33	600478	科力远	700	8,449.00	0.00
34	600122	宏图高科	596	7,974.48	0.00
35	603019	中科曙光	200	7,964.00	0.00
36	600198	大唐电信	400	7,952.00	0.00
37	600635	大众公用	1,300	7,839.00	0.00
38	600312	平高电气	500	7,830.00	0.00
39	600643	爱建集团	800	7,816.00	0.00
40	600200	江苏吴中	400	7,748.00	0.00
41	600143	金发科技	1,200	7,728.00	0.00
41	600138	中青旅	400	7,728.00	0.00
42	600699	均胜电子	200	7,660.00	0.00
43	600418	江淮汽车	600	7,608.00	0.00
44	600655	豫园商城	700	7,588.00	0.00
45	600487	亨通光电	600	7,548.00	0.00
46	600388	龙净环保	600	7,536.00	0.00
47	600673	东阳光科	1,200	7,500.00	0.00
48	600266	北京城建	600	7,494.00	0.00
49	600366	宁波韵升	300	7,161.00	0.00
50	600645	中源协和	200	7,028.00	0.00
51	600240	华业资本	700	7,014.00	0.00
52	600171	上海贝岭	400	6,948.00	0.00
53	002238	天威视讯	480	6,945.60	0.00
54	600884	杉杉股份	400	6,884.00	0.00
55	600151	航天机电	600	6,780.00	0.00
56	600499	科达洁能	400	6,764.00	0.00
57	600410	华胜天成	600	6,732.00	0.00
58	600176	中国巨石	700	6,699.00	0.00
59	600435	北方导航	502	6,681.62	0.00
60	600811	东方集团	1,000	6,660.00	0.00
61	600851	海欣股份	500	6,655.00	0.00
62	600094	大名城	700	6,650.00	0.00
63	600392	盛和资源	400	6,552.00	0.00
64	600687	刚泰控股	400	6,504.00	0.00
65	600160	巨化股份	609	6,473.67	0.00
66	600565	迪马股份	1,000	6,460.00	0.00
67	600601	方正科技	1,500	6,450.00	0.00

68	600516	方大炭素	700	6,398.00	0.00
69	600594	益佰制药	400	6,392.00	0.00
70	600755	厦门国贸	800	6,360.00	0.00
71	600651	飞乐音响	500	6,330.00	0.00
72	600500	中化国际	700	6,328.00	0.00
73	600770	综艺股份	500	6,230.00	0.00
74	600611	大众交通	900	6,129.00	0.00
75	603766	隆鑫通用	300	6,066.00	0.00
76	601929	吉视传媒	1,500	6,045.00	0.00
77	600633	浙报传媒	400	6,016.00	0.00
78	600064	南京高科	400	5,980.00	0.00
79	601311	骆驼股份	300	5,955.00	0.00
80	600787	中储股份	800	5,944.00	0.00
81	600316	洪都航空	300	5,853.00	0.00
82	600572	康恩贝	900	5,832.00	0.00
83	600528	中铁二局	500	5,805.00	0.00
84	600881	亚泰集团	1,200	5,784.00	0.00
85	600058	五矿发展	300	5,631.00	0.00
86	600161	天坛生物	200	5,558.00	0.00
87	601155	新城控股	600	5,556.00	0.00
88	600108	亚盛集团	1,100	5,555.00	0.00
89	600325	华发股份	500	5,535.00	0.00
90	600422	昆药集团	400	5,456.00	0.00
91	600298	安琪酵母	300	5,352.00	0.00
92	601880	大连港	900	5,319.00	0.00
93	600967	北方创业	500	5,315.00	0.00
94	600026	中海发展	900	5,310.00	0.00
95	600426	华鲁恒升	600	5,286.00	0.00
96	600216	浙江医药	400	5,276.00	0.00
97	600017	日照港	1,300	5,265.00	0.00
98	601699	潞安环能	800	5,232.00	0.00
99	603806	福斯特	100	5,219.00	0.00
100	600717	天津港	600	5,214.00	0.00
101	600348	阳泉煤业	800	5,096.00	0.00
102	600597	光明乳业	400	5,072.00	0.00
103	600067	冠城大通	700	5,047.00	0.00
104	600639	浦东金桥	200	4,996.00	0.00
105	600416	湘电股份	400	4,988.00	0.00
106	600536	中国软件	200	4,984.00	0.00

107	603883	老百姓	100	4,974.00	0.00
108	600729	重庆百货	200	4,960.00	0.00
109	600872	中炬高新	400	4,936.00	0.00
110	600260	凯乐科技	300	4,908.00	0.00
111	600557	康缘药业	300	4,899.00	0.00
112	600267	海正药业	400	4,860.00	0.00
113	600086	东方金钰	500	4,840.00	0.00
114	600808	马钢股份	2,000	4,820.00	0.00
115	600056	中国医药	300	4,758.00	0.00
116	600517	置信电气	500	4,755.00	0.00
117	600039	四川路桥	1,200	4,728.00	0.00
118	601777	力帆股份	400	4,708.00	0.00
119	600175	美都能源	1,000	4,700.00	0.00
120	600169	太原重工	1,200	4,680.00	0.00
121	600320	振华重工	1,100	4,675.00	0.00
122	600458	时代新材	300	4,674.00	0.00
123	601010	XD 文峰股	900	4,671.00	0.00
124	600183	生益科技	500	4,635.00	0.00
125	600537	亿晶光电	600	4,626.00	0.00
126	600587	新华医疗	200	4,618.00	0.00
127	600380	健康元	500	4,590.00	0.00
128	600073	上海梅林	400	4,580.00	0.00
129	600736	苏州高新	500	4,565.00	0.00
130	600220	江苏阳光	1,000	4,560.00	0.00
131	600563	法拉电子	100	4,552.00	0.00
132	600580	卧龙电气	400	4,484.00	0.00
133	600187	国中水务	1,000	4,460.00	0.00
134	600006	XD 东风汽	501	4,443.87	0.00
135	600809	山西汾酒	200	4,436.00	0.00
136	601000	唐山港	1,140	4,423.20	0.00
137	600970	中材国际	700	4,410.00	0.00
138	600765	中航重机	300	4,374.00	0.00
139	600575	皖江物流	1,000	4,330.00	0.00
140	600433	冠豪高新	500	4,320.00	0.00
141	600289	亿阳信通	300	4,197.00	0.00
142	600284	浦东建设	400	4,176.00	0.00
143	600805	悦达投资	480	4,166.40	0.00
144	600277	亿利洁能	700	4,165.00	0.00
145	600395	盘江股份	500	4,130.00	0.00

146	600869	智慧能源	400	4,120.00	0.00
147	600823	世茂股份	600	4,074.00	0.00
148	600409	三友化工	600	4,044.00	0.00
149	600351	亚宝药业	400	4,012.00	0.00
150	600894	广日股份	300	3,999.00	0.00
151	601717	郑煤机	700	3,990.00	0.00
152	600460	士兰微	500	3,965.00	0.00
153	600831	广电网络	300	3,888.00	0.00
154	600694	大商股份	100	3,852.00	0.00
155	600125	铁龙物流	600	3,822.00	0.00
156	603355	莱克电气	100	3,810.00	0.00
157	600292	远达环保	300	3,801.00	0.00
158	603005	晶方科技	100	3,787.00	0.00
159	600835	上海机电	196	3,761.24	0.00
160	600993	马应龙	180	3,749.40	0.00
161	600812	华北制药	600	3,726.00	0.00
162	600004	白云机场	300	3,678.00	0.00
163	600062	华润双鹤	200	3,644.00	0.00
164	603589	口子窖	100	3,621.00	0.00
165	603188	亚邦股份	200	3,592.00	0.00
166	600300	维维股份	600	3,564.00	0.00
167	603699	纽威股份	200	3,548.00	0.00
168	600628	新世界	300	3,540.00	0.00
169	600270	外运发展	200	3,498.00	0.00
170	600053	九鼎投资	100	3,463.00	0.00
171	600329	中新药业	200	3,454.00	0.00
172	603077	和邦生物	700	3,444.00	0.00
173	600481	双良节能	600	3,438.00	0.00
174	600496	精工钢构	800	3,408.00	0.00
175	600428	中远航运	600	3,366.00	0.00
176	600236	桂冠电力	500	3,360.00	0.00
177	603025	大豪科技	100	3,357.00	0.00
178	600757	长江传媒	400	3,356.00	0.00
179	600112	天成控股	300	3,348.00	0.00
180	600754	锦江股份	100	3,346.00	0.00
181	600282	南钢股份	1,400	3,290.00	0.00
182	601666	平煤股份	800	3,272.00	0.00
183	601233	桐昆股份	300	3,258.00	0.00
184	601001	大同煤业	600	3,222.00	0.00

185	300244	迪安诊断	97	3,199.06	0.00
186	600825	新华传媒	400	3,180.00	0.00
186	600750	江中药业	100	3,180.00	0.00
187	601126	四方股份	300	3,159.00	0.00
188	600059	古越龙山	300	3,087.00	0.00
189	601886	江河集团	300	3,081.00	0.00
190	601908	京运通	400	3,068.00	0.00
191	601678	滨化股份	600	3,054.00	0.00
192	600859	王府井	200	3,048.00	0.00
193	600132	重庆啤酒	200	3,038.00	0.00
194	600761	安徽合力	300	3,027.00	0.00
195	600180	瑞茂通	200	3,022.00	0.00
196	600586	金晶科技	700	3,010.00	0.00
197	603328	依顿电子	100	2,954.00	0.00
198	600509	天富能源	400	2,940.00	0.00
199	600790	轻纺城	500	2,935.00	0.00
200	600596	新安股份	400	2,916.00	0.00
201	600748	上实发展	300	2,892.00	0.00
202	601965	中国汽研	300	2,883.00	0.00
203	600850	华东电脑	100	2,869.00	0.00
204	603698	航天工程	100	2,744.00	0.00
205	600280	中央商场	400	2,704.00	0.00
206	600720	祁连山	400	2,684.00	0.00
207	600618	氯碱化工	200	2,626.00	0.00
208	600826	兰生股份	100	2,618.00	0.00
209	601002	晋亿实业	300	2,610.00	0.00
210	600466	蓝光发展	300	2,568.00	0.00
211	601369	陕鼓动力	400	2,552.00	0.00
212	600425	青松建化	600	2,550.00	0.00
213	600776	东方通信	300	2,517.00	0.00
214	603555	贵人鸟	100	2,493.00	0.00
215	603169	兰石重装	200	2,492.00	0.00
216	600657	信达地产	500	2,490.00	0.00
217	600251	XD 冠农股	300	2,400.00	0.00
218	603198	迎驾贡酒	100	2,391.00	0.00
219	600088	中视传媒	100	2,372.00	0.00
220	600743	华远地产	500	2,365.00	0.00
221	601801	皖新传媒	200	2,334.00	0.00
222	600874	创业环保	300	2,331.00	0.00

223	603568	伟明环保	100	2,310.00	0.00
224	600141	兴发集团	200	2,304.00	0.00
225	601226	华电重工	250	2,292.50	0.00
226	600617	国新能源	200	2,292.00	0.00
227	600483	福能股份	200	2,270.00	0.00
228	600184	光电股份	100	2,264.00	0.00
229	601515	东风股份	200	2,260.00	0.00
230	600864	哈投股份	200	2,246.00	0.00
231	600335	国机汽车	200	2,242.00	0.00
232	600397	安源煤业	500	2,210.00	0.00
233	603567	珍宝岛	100	2,185.00	0.00
234	600546	*ST 山煤	700	2,149.00	0.00
235	603001	奥康国际	100	2,126.00	0.00
236	600456	宝钛股份	100	2,012.00	0.00
237	600551	时代出版	100	1,996.00	0.00
238	600468	百利电气	140	1,981.00	0.00
238	600623	华谊集团	100	1,981.00	0.00
239	600507	方大特钢	400	1,920.00	0.00
240	600801	华新水泥	300	1,893.00	0.00
241	002030	达安基因	66	1,834.80	0.00
242	600195	中牧股份	100	1,830.00	0.00
243	600510	黑牡丹	200	1,744.00	0.00
244	002698	博实股份	90	1,733.40	0.00
245	600816	安信信托	100	1,687.00	0.00
246	600971	恒源煤电	300	1,656.00	0.00
247	601139	深圳燃气	200	1,600.00	0.00
248	002588	史丹利	120	1,482.00	0.00
249	000418	小天鹅 A	39	1,272.18	0.00
250	002311	海大集团	80	1,261.60	0.00
251	600797	浙大网新	100	1,127.00	0.00
252	000078	海王生物	142	1,055.06	0.00
253	000685	中山公用	99	1,027.62	0.00
254	000860	顺鑫农业	42	998.76	0.00
255	600917	重庆燃气	100	995.00	0.00
256	002025	航天电器	40	987.60	0.00
257	300273	和佳股份	50	957.50	0.00
258	002551	尚荣医疗	38	888.44	0.00
259	002325	洪涛股份	90	827.10	0.00
260	000997	新大陆	40	801.60	0.00

261	002595	豪迈科技	36	769.32	0.00
262	000511	*ST 烯碳	80	713.60	0.00
263	300253	卫宁健康	28	691.60	0.00
264	002681	奋达科技	40	675.20	0.00
265	002408	齐翔腾达	121	664.29	0.00
266	002285	世联行	85	662.15	0.00
267	000718	苏宁环球	50	654.50	0.00
268	601101	昊华能源	100	633.00	0.00
269	002254	泰和新材	40	548.80	0.00
270	600997	开滦股份	100	520.00	0.00
271	002181	粤传媒	60	492.60	0.00
272	002204	大连重工	118	476.72	0.00
273	002266	浙富控股	80	428.00	0.00
274	002013	中航机电	30	404.40	0.00
275	002665	首航节能	49	386.61	0.00
276	002063	远光软件	23	355.35	0.00
277	000541	佛山照明	30	308.70	0.00
278	002092	中泰化学	36	304.56	0.00
279	000732	泰禾集团	12	233.28	0.00
280	002277	友阿股份	20	230.40	0.00
281	000861	海印股份	40	197.60	0.00
282	002140	东华科技	11	167.86	0.00
283	002440	闰土股份	11	163.35	0.00
284	002251	步步高	10	129.70	0.00
285	000572	海马汽车	14	72.66	0.00
286	000897	津滨发展	15	58.05	0.00
287	000582	北部湾港	3	48.96	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600584	长电科技	209,976.00	0.08
2	600522	中天科技	181,479.00	0.07
3	600201	生物股份	162,383.00	0.06
4	600079	人福医药	151,738.00	0.06
5	600503	华丽家族	151,470.00	0.06

6	600482	中国动力	147,867.00	0.06
7	600498	烽火通信	145,056.00	0.06
8	600521	华海药业	144,963.00	0.06
9	600525	长园集团	142,758.00	0.06
10	600879	航天电子	138,780.00	0.05
11	601012	隆基股份	136,500.00	0.05
12	600978	宜华生活	134,160.00	0.05
13	600158	中体产业	131,287.00	0.05
14	600682	南京新百	127,149.00	0.05
15	600478	科力远	127,004.00	0.05
16	600436	片仔癀	125,664.00	0.05
17	600664	哈药股份	124,713.00	0.05
18	600198	大唐电信	121,800.00	0.05
19	603019	中科曙光	119,550.00	0.05
20	600122	宏图高科	119,423.00	0.05

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002018	华信国际	944,992.30	0.37
2	000066	长城电脑	597,941.00	0.24
3	002384	东山精密	395,814.00	0.16
4	600978	宜华生活	231,045.00	0.09
5	600736	苏州高新	144,750.00	0.06

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,353,063.60
卖出股票收入（成交）总额	2,314,542.30

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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 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 500ETF	股票型	交易型开放式	国寿安保基金管理有限公司	225,354,337.33	92.19

7.11 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。

7.12 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投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注**7.13.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除恒康医疗外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。**

恒康医疗于 2016 年 4 月 1 日公告称，2016 年 2 月 1 日，公司及公司控股股东、实际控制人阙文彬先生分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（沪证专调查字 2016123 号、沪证专调查字 2016124 号）。因公司信息披露涉嫌违反证券法律法规，阙文彬先生涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会决定对公司及阙文彬先生进行立案稽查。

7.13.2 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。

7.13.3 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	2,703.99
2	应收证券清算款	2,128,759.44
3	应收股利	-
4	应收利息	3,328.90
5	应收申购款	1,018.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,135,811.11

7.13.4 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。

7.13.5 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	600759	洲际油气	45,707.40	0.02	公告重大事项

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,752	74,536.72	204,860,849.54	47.78%	223,874,381.39	52.22%

8.2 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	71,162.60	0.02%
------------------	-----------	-------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 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
本报告期期初基金份额总额	365,429,862.24
本报告期基金总申购份额	78,327,502.16
减：本报告期基金总赎回份额	15,022,133.47
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	428,735,230.93

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	16,728,858.60	89.61%	12,233.71	89.61%	-
银河证券	1	1,938,747.30	10.39%	1,417.86	10.39%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-	32,118.06	100.00%
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年6月30日
2	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加好买基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年5月10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 2016 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年4月22日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加同花顺、新兰德费率优惠活动公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年4月7日
5	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（摘要）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年3月28日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年3月25日
7	国寿安保基金管理有限公司新增珠海盈米财富管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年3月22日
8	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》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年3月22日
9	国寿安保基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016年3月12日
10	国寿安保基金管理有限公司新增北京懒猫金融信息服务有限公司为销	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司	2016年3月4日

	售机构的公告	网站	
11	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司、恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016 年 3 月 1 日
12	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016 年 2 月 27 日
13	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 4 季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016 年 1 月 20 日
14	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更新招募说明书（摘要）	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016 年 1 月 13 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》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016 年 1 月 8 日
16	国寿安保基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2016 年 1 月 6 日

§ 11 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

12.1.2 《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》

12.1.3 《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》

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 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

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.gsfoods.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司
2016 年 8 月 26 日