

国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 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：2017 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 01 月 01 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.....	5
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 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§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.....	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.....	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.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§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.....	15
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	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52

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	52
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	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
8.12 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
§10 开放式基金份额变动	54
§11 重大事件揭示	54
11.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
11.4 基金投资策略的改变	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
11.8 其他重大事件	56
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金
基金简称	国寿安保沪深 300 指数
基金主代码	000613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 5 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	3,698,278,530.41 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差，实现对标的指数的有效跟踪，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

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	北京复兴门内大街 28 号凯晨世

	院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	贸中心东座 9 层
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王军辉	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	2016 年	2015 年	2014 年 6 月 5 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-12,159,033.31	729,548,502.79	109,687,921.90
本期利润	-275,660,128.43	382,945,602.49	558,216,345.27
加权平均基金份额本期利润	-0.4379	0.5061	0.3063
本期加权平均净值利润率	-34.76%	30.28%	28.81%
本期基金份额净值增长率	-7.77%	6.75%	52.08%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	918,892.45	341,724,787.02	109,724,253.86
期末可供分配基金份额利润	0.0002	0.6234	0.0887
期末基金资产净值	3,699,197,422.86	889,901,612.24	1,881,917,421.86
期末基金份额净值	1.0002	1.6234	1.5208
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	49.72%	62.34%	52.08%

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。

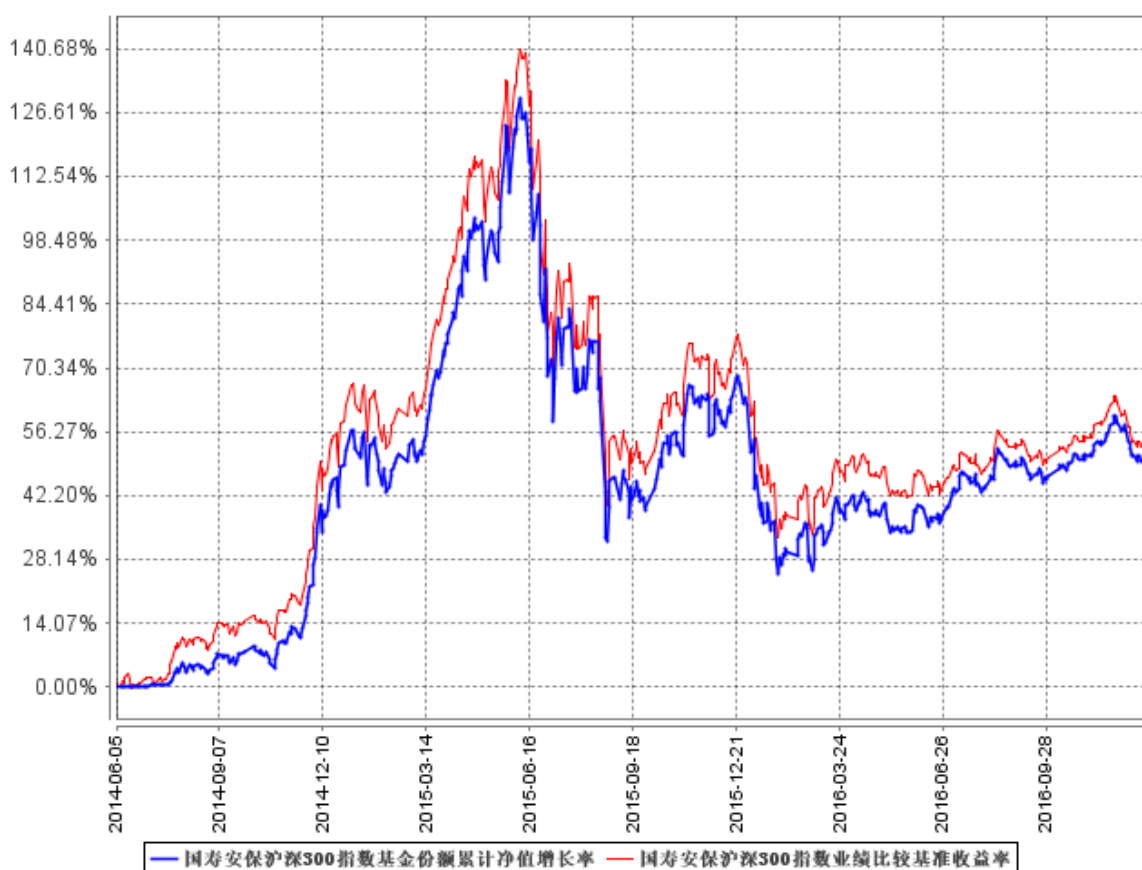
3.2 基金净值表现

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	2.20%	0.64%	1.67%	0.67%	0.53%	-0.03%
过去六个月	7.18%	0.71%	4.72%	0.72%	2.46%	-0.01%
过去一年	-7.77%	1.35%	-10.63%	1.33%	2.86%	0.02%
自基金合同生效起至今	49.72%	1.78%	53.02%	1.78%	-3.30%	0.00%

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

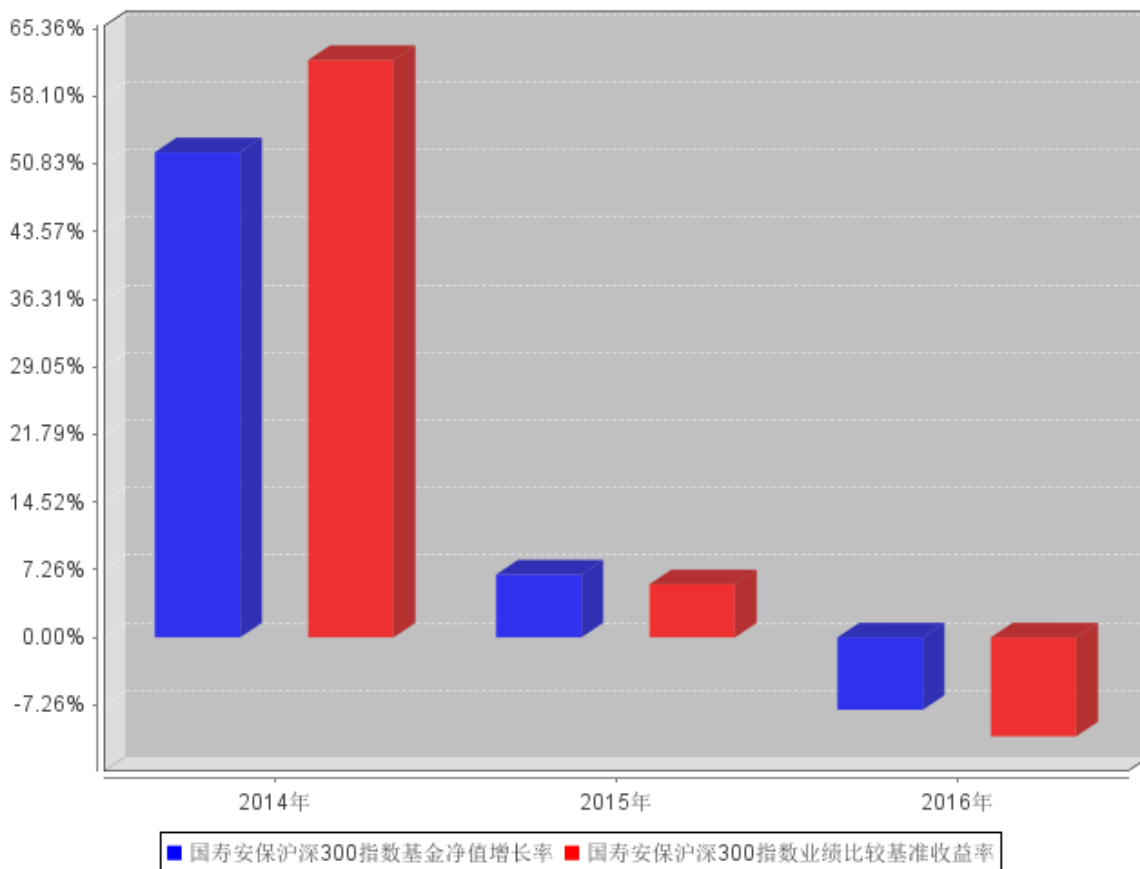
国寿安保沪深300指数基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于2014年06月05日生效，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2014年6月5日至2016年12月31日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保沪深300指数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 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合计	备注
2016	5.2000	1,942,100,599.99	669,672.13	1,942,770,272.12	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	5.2000	1,942,100,599.99	669,672.13	1,942,770,272.12	

§ 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 12 月 31 日，公司共管理 25 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 1151.37 亿元，其中公募基金管理规模 785.16 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		
吴坚	基金经理	2014 年 6 月 5 日	-	9 年	吴坚先生，博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理、中国人寿资产管理有限公司一级研究员，现任国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金、国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金及国寿安保稳健增利混合型证券投资基金基金经理。
李康	基金经理	2015 年 3 月 20 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或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从

行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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标的成份股中国人寿和农业银行的替代投资，以及日常申赎。成份股停复牌和市场波动等因素，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 1.0002 元，累计份额净值为 1.5202 元。报告期内净值增长率为-7.77%，同期业绩基准涨幅为-10.63%。

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 2017 年，宏观经济处于稳中逐步弱复苏的过程，货币政策当前也并未有显著收紧迹象。严控杠杆收购、收紧再融资等监管措施净化了市场环境，将促使市场回归价值投资的良性轨道。经济政策层面，需要关注新兴产业的支持力度，传统产业供给侧改革、国企改革、PPP 和一带一路等。在社会经济转型加速叠加产业政策支持的大背景下，市场结构性机会将不断凸显。整体来看，A 股市场仍将延续结构性投资行情，呈现震荡偏强态势。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数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固定收益品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2016 年 12 月 9 日登记权益并除息，于 2016 年 12 月 12 日每份份额发放 0.52 元红利。

4.9 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 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》等相关法律法规，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(2017)审字第 61090605_A03 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	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年 1 月 1 日至 2016 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沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	辜虹	吴军
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙人）	
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	2017 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	235,068,428.44	52,318,411.46
结算备付金		326.86	-
存出保证金		174,076.66	143,681.80
交易性金融资产	7.4.7.2	3,468,423,417.91	838,354,080.22
其中：股票投资		3,468,423,417.91	838,354,080.22
基金投资		-	-
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	51,831.68	11,542.54
应收股利		-	-
应收申购款		8,818.51	2,097.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,703,726,900.06	890,829,813.92
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	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		429.85	1,645.30
应付管理人报酬		1,364,109.66	377,523.21
应付托管费		272,821.93	75,504.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,392,187.51	85,522.29
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	499,928.25	388,006.20
负债合计		4,529,477.20	928,201.68
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,698,278,530.41	548,176,825.22
未分配利润	7.4.7.10	918,892.45	341,724,787.02
所有者权益合计		3,699,197,422.86	889,901,612.24
负债和所有者权益总计		3,703,726,900.06	890,829,813.92

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.0002 元，基金份额总额 3,698,278,530.41 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-266,361,393.10	394,789,624.88
1. 利息收入		677,108.68	1,275,242.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	677,092.47	444,556.80
债券利息收入		16.21	830,685.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,072,878.31	738,010,073.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-15,621,668.97	724,217,762.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	16,252.59	520,677.73
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	11,532,538.07	13,271,633.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-263,501,095.12	-346,602,900.30
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	535,471.65	2,107,209.41
减：二、费用		9,298,735.33	11,844,022.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,791,350.99	6,362,089.18

2. 托管费	7.4.10.2.2	758,270.23	1,272,417.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,112,383.10	3,516,702.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	636,731.01	692,813.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-275,660,128.43	382,945,602.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-275,660,128.43	382,945,602.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	548,176,825.22	341,724,787.02	889,901,612.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-275,660,128.43	-275,660,128.43
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）	3,150,101,705.19	1,877,624,505.98	5,027,726,211.17
其中：1. 基金申购款	3,827,653,091.71	2,153,159,668.50	5,980,812,760.21
2. 基金赎回款	-677,551,386.52	-275,535,162.52	-953,086,549.04
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）	-	-1,942,770,272.12	-1,942,770,272.12
五、期末所有者权益（基金净值）	3,698,278,530.41	918,892.45	3,699,197,422.86
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 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）	1,237,491,250.57	644,426,171.29	1,881,917,421.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	382,945,602.49	382,945,602.49
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）	-689,314,425.35	-685,646,986.76	-1,374,961,412.11
其中：1. 基金申购款	179,771,638.02	131,842,953.53	311,614,591.55
2. 基金赎回款	-869,086,063.37	-817,489,940.29	-1,686,576,003.66
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）	548,176,825.22	341,724,787.02	889,901,612.24

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金（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[2014]376 号文《关于核准国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金募集的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于 2014 年 5 月 8 日至 2014 年 5 月 30 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（2014）验字第 61090605_02 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 2014 年 6 月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 5,130,087,968.40 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。

本基金为指数型证券投资基金。本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差，实现对标的指数的有效跟踪，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。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)、权证、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、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,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。所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 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；

本基金目前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、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。

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) 本基金合同生效日管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；自 2014 年 6 月 23 日起，年费率变更为 0.50%；

(2) 本基金合同生效日托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；自 2014 年 6 月 23 日起，年费率变更为 0.10%；

(3) 标的指数许可使用费按本基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元按照 5 万元收取）；

(4) 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；

(5) 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) 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，每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

分配方式是现金分红；

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

(4) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 01 月 31 日至 2015 年 12 月 31 日期间均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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日期间均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、增值税

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	235,068,428.44	52,318,411.46
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	235,068,428.44	52,318,411.46

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,629,998,989.96	3,468,423,417.91	-161,575,572.05
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,629,998,989.96	3,468,423,417.91	-161,575,572.05
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	736,428,557.15	838,354,080.22	101,925,523.07
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	736,428,557.15	838,354,080.22	101,925,523.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度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及上年度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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	51,745.44	11,471.48
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	0.11	-
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	86.13	71.06
合计	51,831.68	11,542.54

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,392,187.51	85,522.29
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,392,187.51	85,522.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.62	6.20
预提费用	438,000.00	338,000.00
应付指数使用费	61,926.63	50,000.00
-	-	-
合计	499,928.25	388,006.20

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	548,176,825.22	548,176,825.22
本期申购	3,827,653,091.71	3,827,653,091.71
本期赎回(以“-”号填列)	-677,551,386.52	-677,551,386.52
- 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	3,698,278,530.41	3,698,278,530.41

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
上年度末	668,833,219.52	-327,108,432.50	341,724,787.02
本期利润	-12,159,033.31	-263,501,095.12	-275,660,128.43
本期基金份额交易产生的变动数	3,972,254,042.34	-2,094,629,536.36	1,877,624,505.98
其中：基金申购款	4,769,111,066.91	-2,615,951,398.41	2,153,159,668.50
基金赎回款	-796,857,024.57	521,321,862.05	-275,535,162.52
本期已分配利润	-1,942,770,272.12	-	-1,942,770,272.12
本期末	2,686,157,956.43	-2,685,239,063.98	918,892.45

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
	活期存款利息收入	671,425.98
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	3,303.25	11,042.33
其他	2,363.24	7,923.55
合计	677,092.47	444,556.80

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
	卖出股票成交总额	767,623,088.04

减：卖出股票成本总额	783,244,757.01	1,052,127,513.29
买卖股票差价收入	-15,621,668.97	724,217,762.01

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	16,252.59	520,677.73
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	16,252.59	520,677.73

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	232,268.80	53,217,187.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	216,000.00	51,082,400.00
减：应收利息总额	16.21	1,614,110.07
买卖债券差价收入	16,252.59	520,677.73

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	11,532,538.07	13,271,633.82
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,532,538.07	13,271,633.82

7.4.7.16 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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年
------	----------------------	----------------------------

	年 12 月 31 日	12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-263,501,095.12	-346,602,900.30
——股票投资	-263,501,095.12	-346,596,300.30
——债券投资	-	-6,600.00
——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	-263,501,095.12	-346,602,900.30

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	535,108.21	2,087,861.43
转换费收入	363.44	19,347.98
-	-	-
合计	535,471.65	2,107,209.41

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	4,112,383.10	3,516,277.32
银行间市场交易费用	-	425.00
合计	4,112,383.10	3,516,702.32

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	8,604.38	9,369.82
指数使用费	211,926.63	267,243.28
上清所账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	200.00	200.00

-	-	-
合计	636,731.01	692,813.10

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（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、代销机构
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”）	国寿安保的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
中国人寿财产保险股份有限公司（简称“国寿财险”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间均未发生应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,791,350.99	6,362,089.18
其中：支付销售机构的客户维护费	15,354.34	87,435.11

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金合同生效日管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提；自 2014 年 6 月 23 日起，年费率变更为 0.50%；计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

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

R 为基金管理费年费率

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	758,270.23	1,272,417.79

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金合同生效日托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提；自 2014 年 6 月 23 日起，年费率变更为 0.10%；计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

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

R 为基金托管费年费率

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

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日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。

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

本报告期末及上年度末基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

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 2016 年 12 月 31 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	611,198,823.05	17.88%	150,000,000.00	27.36%
中国人寿	2,967,471,029.59	80.24%	150,039,666.66	27.37%
国寿财产	63,946,156.80	1.73%	-	-

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	235,068,428.44	671,425.98	52,318,411.46	425,590.92

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间均未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

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序	除息日	每 10 份	现金形式	再投资形式	本期利润分配
---	-----	--------	------	-------	--------

号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分 数	发放总额	发放总额	合计	备注
1	2016年12 月9日	-	2016年 12月9 日	5.2000	1,942,100,599.99	669,672.13	1,942,770,272.12	
合 计	-	-		5.2000	1,942,100,599.99	669,672.13	1,942,770,272.12	

7.4.12 期末（2016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

本基金本报告期末及上年度末均无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
000166	申万宏源	2016年12 月21日	公告重 大事项	6.25	2017年1 月26日	6.29	2,349,510	15,979,864.77	14,684,437.50	-
300104	乐视网	2016年12 月7日	公告重 大事项	35.80	2017年1 月16日	36.88	397,000	15,720,489.31	14,212,600.00	-
600406	国电南瑞	2016年12 月29日	公告重 大事项	16.63	未公告	未知	569,042	9,071,251.08	9,463,168.46	-
600485	信威集团	2016年12 月26日	临时停 牌	14.60	未公告	未知	565,100	9,841,334.83	8,250,460.00	-
000750	国海证券	2016年12 月15日	公告重 大事项	6.97	2017年1 月20日	6.27	1,135,700	8,521,919.41	7,915,829.00	-
600654	中安消	2016年12 月14日	公告重 大事项	17.43	未公告	未知	289,400	5,487,780.00	5,044,242.00	-
600875	东方电气	2016年12 月9日	公告重 大事项	10.79	未公告	未知	442,066	4,785,786.97	4,769,892.14	-

600649	城投控股	2016 年 12 月 6 日	公告重大事项	20.34	未公告	未知	119,600	2,098,700.54	2,432,664.00	-
002129	中环股份	2016 年 7 月 6 日	公告重大事项	8.27	未公告	未知	108,000	1,257,850.96	893,160.00	-
601727	上海电气	2016 年 8 月 31 日	公告重大事项	8.42	未公告	未知	60,000	626,872.35	505,200.00	-
000540	中天城投	2016 年 11 月 28 日	公告重大事项	6.93	2017 年 1 月 3 日	7.00	55,100	470,553.77	381,843.00	-

注：本基金本报告期末及上年度末均无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有证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。

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无债券投资，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

单位：人民币元

本期末 2016 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	235,068,428.44	-	-	-	235,068,428.44
结算备付金	326.86	-	-	-	326.86
存出保证金	174,076.66	-	-	-	174,076.66
交易性金融资产	-	-	-	3,468,423,417.91	3,468,423,417.91
应收利息	-	-	-	51,831.68	51,831.68
应收申购款	-	-	-	8,818.51	8,818.51

资产总计	235,242,831.96	-	-	3,468,484,068.10	3,703,726,900.06
负债					
应付赎回款				429.85	429.85
应付管理人报酬				1,364,109.66	1,364,109.66
应付托管费				272,821.93	272,821.93
应付交易费用				2,392,187.51	2,392,187.51
其他负债				499,928.25	499,928.25
负债总计				4,529,477.20	4,529,477.20
利率敏感度缺口	235,242,831.96	-	-	3,463,954,590.90	3,699,197,422.86
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	52,318,411.46	-	-	-	52,318,411.46
存出保证金	143,681.80	-	-	-	143,681.80
交易性金融资产				838,354,080.22	838,354,080.22
应收利息				11,542.54	11,542.54
应收申购款				2,097.90	2,097.90
资产总计	52,462,093.26	-	-	838,367,720.66	890,829,813.92
负债					
应付赎回款				1,645.30	1,645.30
应付管理人报酬				377,523.21	377,523.21
应付托管费				75,504.68	75,504.68
应付交易费用				85,522.29	85,522.29
其他负债				388,006.20	388,006.20
负债总计				928,201.68	928,201.68
利率敏感度缺口	52,462,093.26	-	-	837,439,518.98	889,901,612.24

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，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。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。于 2016 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 2016 年 12 月 31 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	3,468,423,417.91	93.76	838,354,080.22	94.21
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	3,468,423,417.91	93.76	838,354,080.22	94.21

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。下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 系数是根据本报告期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 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	+5%	178,896,873.21	41,917,704.01
-5%	-178,896,873.21	-41,917,704.01	

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 3,399,869,921.81 元（上年度末：790,675,941.22 元），属于第二层次的余额为人民币 68,553,496.10 元（上年度末：47,678,139.00 元），本报告期末及上年度末均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

本基金上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次向第二层次的投资的金额为人民币 18,808,494.00 元，由第二层次转入第一层次的投资的金额为人民币 4,791,725.00 元。本报告期，对于以公允价值计量的金融工具，由第一层次向第二层次的投资的金额为人民币 14,184,624.00 元，由第二层次转入第一层次的投资的金额为人民币 39,288,342.00 元。

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日期间持有的以公允价值计量的金融工具均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 2017 年 3 月 24 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	3,468,423,417.91	93.65
	其中：股票	3,468,423,417.91	93.65
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	235,068,755.30	6.35
7	其他各项资产	234,726.85	0.01
8	合计	3,703,726,900.06	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	10,376,128.00	0.28
B	采矿业	124,479,437.16	3.37
C	制造业	1,113,759,994.18	30.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	94,040,037.44	2.54
E	建筑业	167,830,790.73	4.54
F	批发和零售业	77,131,295.43	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	103,403,173.48	2.80
H	住宿和餐饮业	1,775,701.50	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	233,008,225.06	6.30
J	金融业	1,243,408,702.14	33.61
K	房地产业	165,177,209.45	4.47
L	租赁和商务服务业	36,047,592.86	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	28,220,273.74	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,608,995.30	0.12
R	文化、体育和娱乐业	48,474,466.64	1.31

S	综合	16,681,394.80	0.45
	合计	3,468,423,417.91	93.76

8.2.2 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持有沪港通投资股票投资组合。

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	601318	中国平安	4,237,693	150,141,462.99	4.06
2	601166	兴业银行	5,207,635	84,051,228.90	2.27
3	600016	民生银行	9,231,600	83,822,928.00	2.27
4	600036	招商银行	4,027,800	70,889,280.00	1.92
5	600519	贵州茅台	196,300	65,593,645.00	1.77
6	601328	交通银行	10,728,900	61,905,753.00	1.67
7	000002	万科A	2,676,838	55,009,020.90	1.49
8	600000	浦发银行	3,376,365	54,730,876.65	1.48
9	601668	中国建筑	5,857,300	51,895,678.00	1.40
10	600837	海通证券	3,159,710	49,765,432.50	1.35
11	601398	工商银行	11,244,400	49,587,804.00	1.34
12	600030	中信证券	3,073,465	49,359,847.90	1.33
13	000333	美的集团	1,730,800	48,756,636.00	1.32
14	601169	北京银行	4,750,300	46,362,928.00	1.25
15	000651	格力电器	1,879,300	46,268,366.00	1.25
16	600887	伊利股份	2,368,200	41,680,320.00	1.13
17	601601	中国太保	1,386,163	38,493,746.51	1.04
18	601766	中国中车	3,579,700	34,973,669.00	0.95
19	600900	长江电力	2,577,236	32,627,807.76	0.88
20	601211	国泰君安	1,726,848	32,102,104.32	0.87
21	600104	上汽集团	1,291,625	30,288,606.25	0.82
22	000001	平安银行	3,318,647	30,199,687.70	0.82
23	601988	中国银行	8,230,100	28,311,544.00	0.77
24	000725	京东方A	9,280,200	26,541,372.00	0.72
25	601939	建设银行	4,859,000	26,432,960.00	0.71
26	000858	五粮液	741,200	25,556,576.00	0.69
27	601390	中国中铁	2,874,400	25,467,184.00	0.69
28	601989	中国重工	3,584,900	25,416,941.00	0.69
29	600048	保利地产	2,778,194	25,364,911.22	0.69

30	600276	恒瑞医药	549,971	25,023,680.50	0.68
31	601818	光大银行	6,218,100	24,312,771.00	0.66
32	600050	中国联通	3,310,800	24,201,948.00	0.65
33	601688	华泰证券	1,275,288	22,776,643.68	0.62
34	600015	华夏银行	2,086,260	22,635,921.00	0.61
35	600028	中国石化	4,104,400	22,204,804.00	0.60
36	601186	中国铁建	1,774,300	21,220,628.00	0.57
37	600518	康美药业	1,158,961	20,687,453.85	0.56
38	000776	广发证券	1,155,700	19,485,102.00	0.53
39	601336	新华保险	431,676	18,898,775.28	0.51
40	600958	东方证券	1,206,400	18,735,392.00	0.51
41	002450	康得新	963,378	18,410,153.58	0.50
42	002415	海康威视	715,050	17,025,340.50	0.46
43	002024	苏宁云商	1,454,100	16,649,445.00	0.45
44	002304	洋河股份	235,400	16,619,240.00	0.45
45	601006	大秦铁路	2,322,000	16,439,760.00	0.44
46	601009	南京银行	1,419,600	15,388,464.00	0.42
47	001979	招商蛇口	925,955	15,176,402.45	0.41
48	601857	中国石油	1,896,800	15,079,560.00	0.41
49	002736	国信证券	960,680	14,938,574.00	0.40
50	000063	中兴通讯	928,732	14,813,275.40	0.40
51	600999	招商证券	905,200	14,781,916.00	0.40
52	000166	申万宏源	2,349,510	14,684,437.50	0.40
53	600795	国电电力	4,603,800	14,594,046.00	0.39
54	601899	紫金矿业	4,288,800	14,324,592.00	0.39
55	300104	乐视网	397,000	14,212,600.00	0.38
56	300059	东方财富	833,540	14,111,832.20	0.38
57	601377	兴业证券	1,830,400	14,002,560.00	0.38
58	601099	太平洋	2,661,595	13,707,214.25	0.37
59	000783	长江证券	1,295,500	13,252,965.00	0.36
60	600585	海螺水泥	780,900	13,244,064.00	0.36
61	601985	中国核电	1,823,500	12,873,910.00	0.35
62	300070	碧水源	725,411	12,709,200.72	0.34
63	002142	宁波银行	761,490	12,671,193.60	0.34
64	601088	中国神华	772,862	12,504,907.16	0.34
65	601901	方正证券	1,607,400	12,216,240.00	0.33
66	601788	光大证券	747,500	11,952,525.00	0.32
67	600637	东方明珠	512,717	11,946,306.10	0.32
68	000503	海虹控股	280,700	11,803,435.00	0.32

69	600690	青岛海尔	1,190,515	11,762,288.20	0.32
70	601669	中国电建	1,611,300	11,698,038.00	0.32
71	000625	长安汽车	767,600	11,467,944.00	0.31
72	600089	特变电工	1,253,900	11,448,107.00	0.31
73	600383	金地集团	878,795	11,389,183.20	0.31
74	000768	中航飞机	535,090	11,376,013.40	0.31
75	002673	西部证券	545,732	11,334,853.64	0.31
76	000423	东阿阿胶	204,328	11,007,149.36	0.30
77	601555	东吴证券	820,068	10,882,302.36	0.29
78	601600	中国铝业	2,546,300	10,745,386.00	0.29
79	600705	中航资本	1,752,500	10,725,300.00	0.29
80	600109	国金证券	820,800	10,695,024.00	0.29
81	600703	三安光电	796,400	10,663,796.00	0.29
82	600010	宝钢股份	3,814,400	10,642,176.00	0.29
83	600547	山东黄金	290,100	10,591,551.00	0.29
84	002594	比亚迪	212,463	10,555,161.84	0.29
85	600886	国投电力	1,576,600	10,515,922.00	0.28
86	600535	天士力	253,265	10,507,964.85	0.28
87	002202	金风科技	611,098	10,455,886.78	0.28
88	600111	北方稀土	851,090	10,442,874.30	0.28
89	300072	三聚环保	222,951	10,320,401.79	0.28
90	600660	福耀玻璃	547,500	10,199,925.00	0.28
91	002456	欧菲光	296,889	10,177,354.92	0.28
92	600066	宇通客车	518,900	10,165,251.00	0.27
93	600009	上海机场	376,097	9,974,092.44	0.27
94	600893	中航动力	304,326	9,963,633.24	0.27
95	002739	万达院线	183,497	9,921,682.79	0.27
96	600068	葛洲坝	1,078,871	9,914,824.49	0.27
97	300017	网宿科技	184,800	9,907,128.00	0.27
98	000839	中信国安	1,071,650	9,837,747.00	0.27
99	600804	鹏博士	441,800	9,688,674.00	0.26
100	600029	南方航空	1,371,200	9,625,824.00	0.26
101	600100	同方股份	694,400	9,617,440.00	0.26
102	002230	科大讯飞	353,700	9,581,733.00	0.26
103	002241	歌尔股份	357,800	9,488,856.00	0.26
104	600406	国电南瑞	569,042	9,463,168.46	0.26
105	000338	潍柴动力	945,700	9,419,172.00	0.25
106	600415	小商品城	1,062,800	9,193,220.00	0.25
107	000728	国元证券	460,000	9,154,000.00	0.25

108	300024	机器人	426,279	9,113,845.02	0.25
109	600570	恒生电子	192,984	9,097,265.76	0.25
110	600309	万华化学	422,200	9,089,966.00	0.25
111	600196	复星医药	392,599	9,084,740.86	0.25
112	600031	三一重工	1,485,900	9,063,990.00	0.25
113	601800	中国交建	596,300	9,057,797.00	0.24
114	000568	泸州老窖	273,786	9,034,938.00	0.24
115	002252	上海莱士	387,824	8,954,856.16	0.24
116	000069	华侨城A	1,281,800	8,908,510.00	0.24
117	000793	华闻传媒	788,500	8,902,165.00	0.24
118	601618	中国中冶	1,902,300	8,864,718.00	0.24
119	601607	上海医药	450,536	8,812,484.16	0.24
120	000009	中国宝安	839,230	8,694,422.80	0.24
121	000623	吉林敖东	279,300	8,655,507.00	0.23
122	600023	浙能电力	1,593,300	8,651,619.00	0.23
123	601198	东兴证券	430,646	8,638,758.76	0.23
124	600271	航天信息	432,600	8,630,370.00	0.23
125	600739	辽宁成大	477,900	8,583,084.00	0.23
126	600867	通化东宝	387,800	8,504,454.00	0.23
127	002065	东华软件	364,558	8,494,201.40	0.23
128	600177	雅戈尔	599,366	8,379,136.68	0.23
129	600221	海南航空	2,567,200	8,369,072.00	0.23
130	600340	华夏幸福	346,200	8,274,180.00	0.22
131	601888	中国国旅	190,647	8,274,079.80	0.22
132	600115	东方航空	1,168,100	8,258,467.00	0.22
133	600485	信威集团	565,100	8,250,460.00	0.22
134	000413	东旭光电	732,500	8,247,950.00	0.22
135	600352	浙江龙盛	889,300	8,190,453.00	0.22
136	600816	安信信托	345,700	8,165,434.00	0.22
137	600489	中金黄金	673,700	8,145,033.00	0.22
138	000895	双汇发展	386,500	8,089,445.00	0.22
139	000630	铜陵有色	2,613,400	8,049,272.00	0.22
140	600820	隧道股份	730,400	8,041,704.00	0.22
141	600606	绿地控股	909,800	7,924,358.00	0.21
142	000750	国海证券	1,135,700	7,915,829.00	0.21
143	600369	西南证券	1,102,200	7,858,686.00	0.21
144	600741	华域汽车	492,500	7,855,375.00	0.21
145	601919	中远海控	1,490,800	7,811,792.00	0.21
146	601018	宁波港	1,540,789	7,796,392.34	0.21

147	000157	中联重科	1,715,430	7,788,052.20	0.21
148	002465	海格通信	666,000	7,758,900.00	0.21
149	002236	大华股份	566,012	7,743,044.16	0.21
150	002007	华兰生物	216,057	7,724,037.75	0.21
151	600157	永泰能源	1,916,600	7,685,566.00	0.21
152	601998	中信银行	1,196,800	7,671,488.00	0.21
153	600718	东软集团	388,400	7,635,944.00	0.21
154	300124	汇川技术	375,585	7,635,643.05	0.21
155	002008	大族激光	333,000	7,525,800.00	0.20
156	600674	川投能源	859,500	7,477,650.00	0.20
157	600150	中国船舶	269,100	7,429,851.00	0.20
158	601933	永辉超市	1,494,900	7,339,959.00	0.20
159	002466	天齐锂业	224,300	7,278,535.00	0.20
160	600118	中国卫星	231,100	7,219,564.00	0.20
161	601111	中国国航	998,265	7,187,508.00	0.19
162	600153	建发股份	664,100	7,105,870.00	0.19
163	300027	华谊兄弟	644,034	7,084,374.00	0.19
164	300315	掌趣科技	757,451	6,998,847.24	0.19
165	002475	立讯精密	331,100	6,870,325.00	0.19
166	000686	东北证券	548,460	6,778,965.60	0.18
167	002085	万丰奥威	342,700	6,771,752.00	0.18
168	600061	国投安信	432,600	6,752,886.00	0.18
169	000060	中金岭南	604,900	6,744,635.00	0.18
170	600085	同仁堂	214,300	6,724,734.00	0.18
171	601333	广深铁路	1,324,200	6,713,694.00	0.18
172	600959	江苏有线	591,400	6,682,820.00	0.18
173	000826	启迪桑德	200,199	6,602,563.02	0.18
174	000876	新希望	813,900	6,551,895.00	0.18
175	600170	上海建工	1,378,500	6,520,305.00	0.18
176	600018	上港集团	1,266,900	6,486,528.00	0.18
177	000917	电广传媒	442,800	6,371,892.00	0.17
178	600583	海油工程	863,200	6,370,416.00	0.17
179	000963	华东医药	87,165	6,281,981.55	0.17
180	002183	怡亚通	569,600	6,185,856.00	0.17
181	002081	金螳螂	619,156	6,061,537.24	0.16
182	600839	四川长虹	1,442,000	6,027,560.00	0.16
183	600588	用友网络	285,798	5,950,314.36	0.16
184	000559	万向钱潮	447,867	5,938,716.42	0.16
185	600256	广汇能源	1,223,400	5,713,278.00	0.15

186	002310	东方园林	402,600	5,696,790.00	0.15
187	002385	大北农	800,525	5,683,727.50	0.15
188	300168	万达信息	279,500	5,651,490.00	0.15
189	603993	洛阳钼业	1,517,400	5,644,728.00	0.15
190	600208	新湖中宝	1,343,100	5,587,296.00	0.15
191	300033	同花顺	80,800	5,557,424.00	0.15
192	300058	蓝色光标	546,318	5,556,054.06	0.15
193	601718	际华集团	602,500	5,549,025.00	0.15
194	000709	河钢股份	1,658,500	5,539,390.00	0.15
195	000792	盐湖股份	290,200	5,534,114.00	0.15
196	600688	上海石化	855,800	5,511,352.00	0.15
197	600362	江西铜业	324,300	5,425,539.00	0.15
198	600895	张江高科	302,400	5,358,528.00	0.14
199	002426	胜利精密	643,200	5,319,264.00	0.14
200	600297	广汇汽车	620,500	5,311,480.00	0.14
201	002500	山西证券	441,800	5,310,436.00	0.14
202	600005	武钢股份	1,548,200	5,279,362.00	0.14
203	600332	白云山	219,404	5,261,307.92	0.14
204	600060	海信电器	306,500	5,247,280.00	0.14
205	601633	长城汽车	470,500	5,203,730.00	0.14
206	002074	国轩高科	164,900	5,110,251.00	0.14
207	601866	中远海发	1,239,006	5,055,144.48	0.14
208	601258	庞大集团	1,821,900	5,046,663.00	0.14
209	600654	中安消	289,400	5,044,242.00	0.14
210	600074	保千里	380,700	5,040,468.00	0.14
211	000983	西山煤电	592,500	5,012,550.00	0.14
212	600737	中粮屯河	400,500	4,990,230.00	0.13
213	600252	中恒集团	1,085,500	4,971,590.00	0.13
214	000977	浪潮信息	234,200	4,965,040.00	0.13
215	600498	烽火通信	196,700	4,958,807.00	0.13
216	300002	神州泰岳	532,531	4,920,586.44	0.13
217	600446	金证股份	195,600	4,915,428.00	0.13
218	000402	金融街	472,700	4,868,810.00	0.13
219	002470	金正大	612,900	4,841,910.00	0.13
220	600875	东方电气	442,066	4,769,892.14	0.13
221	600376	首开股份	402,900	4,758,249.00	0.13
222	300144	宋城演艺	226,796	4,749,108.24	0.13
223	600873	梅花生物	728,300	4,748,516.00	0.13
224	600666	奥瑞德	175,200	4,721,640.00	0.13

225	002292	奥飞娱乐	204,215	4,635,680.50	0.13
226	600704	物产中大	448,300	4,630,939.00	0.13
227	300015	爱尔眼科	154,147	4,608,995.30	0.12
228	601216	君正集团	988,500	4,596,525.00	0.12
229	002049	紫光国芯	136,877	4,508,728.38	0.12
230	600827	百联股份	312,627	4,489,323.72	0.12
231	600038	中直股份	92,200	4,464,324.00	0.12
232	000738	中航动控	178,806	4,423,660.44	0.12
233	000778	新兴铸管	853,500	4,412,595.00	0.12
234	000039	中集集团	295,249	4,316,540.38	0.12
235	600373	中文传媒	212,000	4,282,400.00	0.12
236	002195	二三四五	373,400	4,226,888.00	0.11
237	002152	广电运通	316,000	4,196,480.00	0.11
238	600037	歌华有线	271,600	4,160,912.00	0.11
239	000712	锦龙股份	175,000	4,102,000.00	0.11
240	601872	招商轮船	827,700	4,088,838.00	0.11
241	002146	荣盛发展	509,400	3,998,790.00	0.11
242	600482	中国动力	130,800	3,994,632.00	0.11
243	300182	捷成股份	385,400	3,973,474.00	0.11
244	000156	华数传媒	221,071	3,959,381.61	0.11
245	000718	苏宁环球	456,300	3,937,869.00	0.11
246	601155	新城控股	334,000	3,924,500.00	0.11
247	600008	首创股份	941,188	3,868,282.68	0.10
248	002131	利欧股份	241,700	3,855,115.00	0.10
249	600372	中航电子	205,829	3,820,186.24	0.10
250	603000	人民网	215,700	3,809,262.00	0.10
251	601225	陕西煤业	781,000	3,787,850.00	0.10
252	600685	中船防务	126,600	3,760,020.00	0.10
253	000627	天茂集团	480,400	3,675,060.00	0.10
254	002714	牧原股份	155,600	3,622,368.00	0.10
255	002299	圣农发展	167,200	3,547,984.00	0.10
256	000800	一汽轿车	317,700	3,453,399.00	0.09
257	601021	春秋航空	93,653	3,440,811.22	0.09
258	002174	游族网络	129,498	3,425,222.10	0.09
259	002027	分众传媒	238,700	3,406,249.00	0.09
260	300146	汤臣倍健	284,200	3,393,348.00	0.09
261	601611	中国核建	197,300	3,391,587.00	0.09
262	000671	阳光城	608,900	3,391,573.00	0.09
263	300251	光线传媒	343,700	3,354,512.00	0.09

264	600582	天地科技	646,500	3,213,105.00	0.09
265	601118	海南橡胶	460,600	3,205,776.00	0.09
266	000027	深圳能源	464,400	3,190,428.00	0.09
267	000938	紫光股份	55,000	3,156,450.00	0.09
268	002797	第一创业	90,500	3,149,400.00	0.09
269	000061	农产品	253,700	3,138,269.00	0.08
270	002424	贵州百灵	165,400	3,132,676.00	0.08
271	601928	凤凰传媒	298,300	3,123,201.00	0.08
272	300133	华策影视	272,920	3,097,642.00	0.08
273	002153	石基信息	125,100	3,048,687.00	0.08
274	601877	正泰电器	148,800	2,976,000.00	0.08
275	000008	神州高铁	311,200	2,900,384.00	0.08
276	600871	石化油服	705,300	2,891,730.00	0.08
277	601958	金钼股份	378,000	2,891,700.00	0.08
278	600648	外高桥	145,900	2,880,066.00	0.08
279	601608	中信重工	508,300	2,851,563.00	0.08
280	600783	鲁信创投	116,200	2,628,444.00	0.07
281	000538	云南白药	32,442	2,470,458.30	0.07
282	600649	城投控股	119,600	2,432,664.00	0.07
283	600019	宝钢股份	360,000	2,286,000.00	0.06
284	300085	银之杰	106,900	2,234,210.00	0.06
285	000555	神州信息	103,600	2,199,428.00	0.06
286	603885	吉祥航空	92,500	2,155,250.00	0.06
287	600754	锦江股份	60,275	1,775,701.50	0.05
288	600188	兖州煤业	150,200	1,631,172.00	0.04
289	002568	百润股份	66,100	1,337,864.00	0.04
290	000100	TCL 集团	278,600	919,380.00	0.02
291	002129	中环股份	108,000	893,160.00	0.02
292	601727	上海电气	60,000	505,200.00	0.01
293	000540	中天城投	55,100	381,843.00	0.01
294	600663	陆家嘴	17,100	378,423.00	0.01
295	601127	小康股份	11,700	312,858.00	0.01
296	000415	渤海金控	41,100	293,865.00	0.01
297	000425	徐工机械	83,300	281,554.00	0.01
298	600021	上海电力	19,800	240,372.00	0.01

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	601318	中国平安	154,156,301.04	17.32
2	601166	兴业银行	88,077,048.22	9.90
3	600016	民生银行	87,968,378.63	9.89
4	600036	招商银行	75,078,664.00	8.44
5	000002	万科A	64,529,570.00	7.25
6	601328	交通银行	64,219,049.00	7.22
7	600519	贵州茅台	62,611,581.73	7.04
8	600000	浦发银行	58,773,012.50	6.60
9	601668	中国建筑	54,453,050.00	6.12
10	600837	海通证券	52,588,345.50	5.91
11	601398	工商银行	52,356,819.00	5.88
12	600030	中信证券	52,055,430.00	5.85
13	000333	美的集团	50,051,972.24	5.62
14	000651	格力电器	48,747,316.40	5.48
15	601169	北京银行	47,827,862.89	5.37
16	600887	伊利股份	43,100,423.84	4.84
17	601601	中国太保	41,933,246.42	4.71
18	601766	中国中车	38,562,859.60	4.33
19	600900	长江电力	34,832,639.52	3.91
20	601211	国泰君安	33,401,625.28	3.75
21	600104	上汽集团	31,764,642.87	3.57
22	000001	平安银行	31,546,075.69	3.54
23	601988	中国银行	29,068,437.00	3.27
24	601939	建设银行	28,335,406.00	3.18
25	600048	保利地产	27,370,642.95	3.08
26	000725	京东方A	26,822,594.00	3.01
27	601989	中国重工	26,776,640.00	3.01
28	000858	五粮液	26,479,754.00	2.98
29	601390	中国中铁	26,323,293.09	2.96
30	600276	恒瑞医药	25,904,630.83	2.91
31	601818	光大银行	25,250,149.00	2.84
32	600015	华夏银行	24,087,610.15	2.71
33	601688	华泰证券	23,962,895.48	2.69
34	601186	中国铁建	22,004,861.54	2.47

35	600028	中国石化	21,969,570.57	2.47
36	600050	中国联通	21,956,190.37	2.47
37	000776	广发证券	21,258,830.00	2.39
38	600958	东方证券	21,044,319.25	2.36
39	600518	康美药业	20,238,141.11	2.27
40	601336	新华保险	19,822,006.78	2.23
41	002415	海康威视	18,158,154.37	2.04
42	002450	康得新	18,100,186.32	2.03
43	002024	苏宁云商	17,806,075.00	2.00

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	601318	中国平安	30,961,734.14	3.48
2	600016	民生银行	24,153,777.85	2.71
3	601166	兴业银行	18,218,028.22	2.05
4	600036	招商银行	15,409,597.58	1.73
5	600000	浦发银行	14,464,276.09	1.63
6	601398	工商银行	13,976,271.64	1.57
7	601328	交通银行	12,348,292.41	1.39
8	600519	贵州茅台	11,980,714.03	1.35
9	600030	中信证券	11,091,531.51	1.25
10	000002	万科A	10,526,096.40	1.18
11	600837	海通证券	10,441,611.81	1.17
12	601601	中国太保	9,099,313.99	1.02
13	601169	北京银行	9,070,741.66	1.02
14	600887	伊利股份	8,534,001.90	0.96
15	000651	格力电器	8,495,246.44	0.95
16	601939	建设银行	8,298,379.00	0.93
17	601766	中国中车	7,583,404.95	0.85
18	601668	中国建筑	7,468,451.52	0.84
19	000333	美的集团	6,678,365.00	0.75
20	600900	长江电力	6,210,432.12	0.70

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	3,676,815,189.82
卖出股票收入（成交）总额	844,221,907.52

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除海通证券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。

2016年11月28日，海通证券股份有限公司（以下简称海通证券）收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]127号）。海通证券未按要求采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。证监会对海通证券责令改正，给予警

告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

8.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

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。

8.12.3 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	174,076.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,831.68
5	应收申购款	8,818.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234,726.85

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 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
790	4,681,365.23	3,692,616,009.44	99.85%	5,662,520.97	0.15%

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	355,397.97	0.01%
------------------	------------	-------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年6月5日）基金份额总额	5,130,087,968.40
本报告期期初基金份额总额	548,176,825.22
本报告期基金总申购份额	3,827,653,091.71
减:本报告期基金总赎回份额	677,551,386.52
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	3,698,278,530.41

注：报告期内基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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，本基金管理人于 2016 年 12 月 30 日发布公告，王军辉先生自 2016 年 12 月 28 日起任国寿安保基金管理有限公司董事长，相关任职资格已经中国证监会核准，刘慧敏先生因工作调动不再担任。

本报告期内，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	
方正证券	2	22,895,231,858.40	65.24%	1,827,762.60	61.99%	-
国泰君安	2	567,463,434.61	12.79%	528,478.93	17.92%	-
中金公司	2	541,206,457.38	12.20%	233,423.43	7.92%	-
海通证券	2	119,653,186.23	2.70%	111,432.98	3.78%	-
中信证券	2	115,353,054.07	2.60%	107,428.37	3.64%	-
申万宏源	2	78,543,981.97	1.77%	57,439.61	1.95%	-
中银国际	2	50,887,386.36	1.15%	32,125.16	1.09%	-
兴业证券	2	45,534,290.08	0.96%	33,299.03	1.06%	-
长城证券	2	26,644,776.06	0.60%	19,485.40	0.66%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，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
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	31,077.80	13.38%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	201,191.00	86.62%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
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	国寿安保基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金临时调整交易时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月4日
2	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时	2016年1月6日

	停申购赎回业务的公告	报》及公司网站	
3	国寿安保基金管理有限公司关于指数熔断后旗下部分基金临时调整交易时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金更新招募说明书摘要（2016 第 1 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 18 日
5	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 1 月 20 日
6	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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 2 月 27 日
7	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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 1 日
8	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	2016 年 3 月 4 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》、《上海证券报》、《证券时报》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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 22 日
11	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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 25 日

	为销售机构的公告	报》及公司网站	
12	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2015 年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 28 日
13	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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 4 月 7 日
14	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 4 月 22 日
15	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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 5 月 10 日
16	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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 6 月 30 日
17	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	2016 年 7 月 5 日
18	国寿安保基金管理有限公司系统升级公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 8 日
19	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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 9 日
20	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金在中国建设银行股份有限公司开通定期定额投资业务的	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 14 日

	公告		
21	国寿安保沪深 300 指数型证券市场基金更新招募说明书摘要（2016 年第 2 号）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 18 日
22	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 20 日
23	国寿安保基金关于参加诺亚正行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	2016 年 7 月 21 日
24	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加上海联泰资产管理有限公司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	2016 年 8 月 22 日
25	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 8 月 26 日
26	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额申购手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 21 日
27	国寿安保基金管理有限公司新增北京汇成基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 26 日
28	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加北京懒猫金融信息服务有限公司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	2016 年 9 月 29 日

29	国寿安保基金管理有限公司新增北京肯特瑞财富投资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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 29 日
30	国寿安保基金管理有限公司 2016 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	2016 年 10 月 24 日
31	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增广发银行为销售机构并在广发银行推出定期定额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 10 月 17 日
32	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增上海华信证券有限责任公司为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	2016 年 11 月 11 日
33	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 11 月 30 日
34	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 7 日
35	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加广发银行有米直销银行渠道基金申购投资手续费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 13 日
36	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增北京植信基金销售有限公司为销售机构并参加费率	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 22 日

	优惠活动的公告		
37	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售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》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 22 日
38	国寿安保基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 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沪深 300 指数型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保沪深 300 指数型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 报告期内国寿安保沪深 300 指数型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.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

2017 年 3 月 28 日