

国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 25 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合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 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.....	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	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息	45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 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	2,159,538,972.45 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	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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	38,459,700.48
本期利润	334,283,303.18
加权平均基金份额本期利润	0.0954
本期加权平均净值利润率	9.19%
本期基金份额净值增长率	10.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	230,202,438.46
期末可供分配基金份额利润	0.1066
期末基金资产净值	2,389,741,410.91
期末基金份额净值	1.1066
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	65.65%

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。

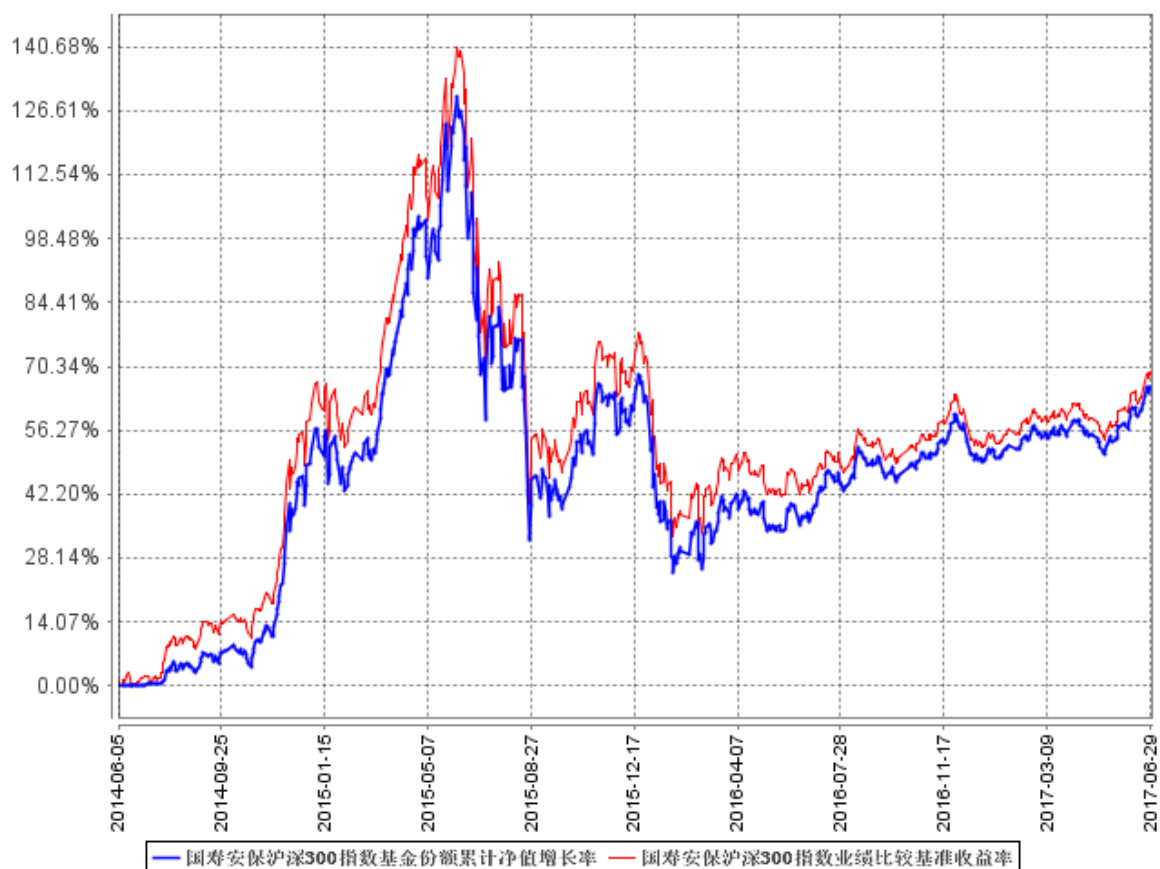
3.2 基金净值表现

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	5.07%	0.61%	4.73%	0.64%	0.34%	-0.03%
过去三个月	6.34%	0.58%	5.80%	0.59%	0.54%	-0.01%
过去六个月	10.64%	0.53%	10.23%	0.54%	0.41%	-0.01%
过去一年	18.58%	0.63%	15.44%	0.63%	3.14%	0.00%
过去三年	65.18%	1.67%	65.95%	1.66%	-0.77%	0.01%
自基金合同生效起至今	65.65%	1.65%	68.69%	1.65%	-3.04%	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 6 月 5 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2014年06月05日至2017年06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2017年06月30日，公司共管理31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1410.13亿元，其中公募基金管理规模1006.76亿元。

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	-	10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	2015年3月20	-	7年	李康先生，博士研究生。

	理	日			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，指数成份股定期调整。以及日常申赎、成份股停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 1.1066 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.64%，业绩比较基准收益率为 10.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年股市风格分化明显，小盘成长股和大盘蓝筹股走势差异显著。投资者风险偏好有所下降，倾向于稳健价值投资策略。以漂亮 50 为代表的大盘蓝筹备受青睐，白酒家电保险等业绩稳健增长板块涨幅领先。至 6 月底，沪深 300 年内涨幅达 10.78%。展望下半年，经济逐渐企稳，中央金融工作会议强调金融服务实体经济，会议中强调脱虚向实、整治金融乱象，整体风险偏好不会大幅上升。财政政策将保持稳健。货币政策偏谨慎，但收紧的空间相对有限，以避免资金面大的波动导致系统性金融风险。经济政策层面，需继续关注国企改革的推进，以及党的十九大对未来五年的整体规划等。整体来看下半年 A 股市场出现大幅波动的概率不大，将以结构性行情为主。外围市场方面，美联储计划缩减资产负债表，缩表进程和加息节奏值得关注。

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。

4.7 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 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 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

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：国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	385,455,751.62	235,068,428.44
结算备付金		401,336.01	326.86
存出保证金		1,105,781.85	174,076.66
交易性金融资产	6.4.7.2	2,390,644,174.12	3,468,423,417.91
其中：股票投资		2,390,644,174.12	3,468,423,417.91
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	47,043.55	51,831.68
应收股利		-	-
应收申购款		119,519.67	8,818.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,777,773,606.82	3,703,726,900.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		177,543.61	-
应付赎回款		382,620,048.43	429.85
应付管理人报酬		1,248,069.86	1,364,109.66
应付托管费		249,614.00	272,821.93
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	1,674,181.04	2,392,187.51
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	2,062,738.97	499,928.25
负债合计		388,032,195.91	4,529,477.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,159,538,972.45	3,698,278,530.41
未分配利润	6.4.7.10	230,202,438.46	918,892.45
所有者权益合计		2,389,741,410.91	3,699,197,422.86
负债和所有者权益总计		2,777,773,606.82	3,703,726,900.06

注：报告截止日 2017 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.1066 元，基金份额总额 2,159,538,972.45 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		349,292,389.04	-138,385,930.34
1.利息收入		876,422.52	172,211.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	867,324.39	172,195.27
债券利息收入		533.39	16.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,564.74	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		50,533,141.85	-22,476,726.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	25,326,763.40	-27,914,358.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	140,354.11	16,252.59
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	25,066,024.34	5,421,379.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	295,823,602.70	-116,474,222.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,059,221.97	392,807.13

减：二、费用		15,009,085.86	3,194,768.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,043,567.30	1,782,463.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,808,713.51	356,492.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,593,696.53	745,508.11
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	563,108.52	310,303.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		334,283,303.18	-141,580,698.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		334,283,303.18	-141,580,698.90

6.3 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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	3,698,278,530.41	918,892.45	3,699,197,422.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	334,283,303.18	334,283,303.18
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）	-1,538,739,557.96	-104,999,757.17	-1,643,739,315.13
其中：1. 基金申购款	3,687,985.50	135,640.77	3,823,626.27
2. 基金赎回款	-1,542,427,543.46	-105,135,397.94	-1,647,562,941.40
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）	2,159,538,972.45	230,202,438.46	2,389,741,410.91
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	-141,580,698.90	-141,580,698.90
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)	-142,351,434.87	-39,090,629.61	-181,442,064.48
其中：1.基金申购款	94,652,876.18	38,350,436.82	133,003,313.00
2.基金赎回款	-237,004,311.05	-77,441,066.43	-314,445,377.48
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)	405,825,390.35	161,053,458.51	566,878,848.86

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 06 月 05 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,这也是业内今年首只以沪深 300 指数为投资标的

的指数基金。国寿安保沪深 300 指数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（蓝筹股）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%。

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 3 号《半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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期及上年度可比期间 2016 年 06 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日期间均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 04 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 09 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、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 01 月 01 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 05 月 01 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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 01 月 01 日起资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 01 月 01 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。

6.4.6.3 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 01 月 01 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。

6.4.6.4 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 01 月 01 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 09 月 08 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	385,455,751.62
定期存款	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	385,455,751.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,256,396,143.47	2,390,644,174.12	134,248,030.65
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	2,256,396,143.47	2,390,644,174.12	134,248,030.65

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金于本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	46,365.35
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	180.60
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	497.60
合计	47,043.55

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,674,181.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,674,181.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,441,935.30
预提费用	446,437.29
应付指数使用费	174,366.38
-	-
合计	2,062,738.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,698,278,530.41	3,698,278,530.41
本期申购	3,687,985.50	3,687,985.50
本期赎回(以“-”号填列)	-1,542,427,543.46	-1,542,427,543.46
- 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	2,159,538,972.45	2,159,538,972.45

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	2,686,157,956.43	-2,685,239,063.98	918,892.45
本期利润	38,459,700.48	295,823,602.70	334,283,303.18
本期基金份额交易产生的变动数	-1,121,780,920.19	1,016,781,163.02	-104,999,757.17
其中：基金申购款	2,678,746.37	-2,543,105.60	135,640.77
基金赎回款	-1,124,459,666.56	1,019,324,268.62	-105,135,397.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,602,836,736.72	-1,372,634,298.26	230,202,438.46

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	807,267.99
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	48,815.32
其他	11,241.08
合计	867,324.39

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,702,911,817.76
减：卖出股票成本总额	1,677,585,054.36
买卖股票差价收入	25,326,763.40

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	140,354.11
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	140,354.11

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,820,887.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,680,000.00
减：应收利息总额	533.39
买卖债券差价收入	140,354.11

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	25,066,024.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,066,024.34

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	295,823,602.70
——股票投资	295,823,602.70
——债券投资	-
——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	295,823,602.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,059,025.73
转换费收入	196.24
-	-
合计	2,059,221.97

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	3,593,696.53
银行间市场交易费用	-

合计	3,593,696.53
----	--------------

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
中债登账户维护费	9,000.00
银行费用	3,928.56
指数使用费	361,742.67
上清所账户维护费	-
其他	-
-	-
合计	563,108.52

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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、代销机构
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间2017年1月1日至2017年03月30日期间

均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 06 月 30 日期间均未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,043,567.30	1,782,463.80
其中：支付销售机构的客户维护费	6,442.44	7,685.23

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 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金管理费年费率

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,808,713.51	356,492.79

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为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

6.4.10.2.3 销售服务费

无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间2017年1月1日至2017年06月30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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金的情况。

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 2017年6月30日		上年度末 2016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
中国人寿	2,039,578,076.53	94.45%	2,967,471,029.59	80.24%
集团公司	112,602,316.05	5.21%	611,198,823.05	17.88%

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	385,455,751.62	807,267.99	36,743,833.39	168,676.70

6.4.10.6 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2017年1月1日至2017年06月30日期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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2017年1月1日至2017年06月30日期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

		日	3日							
--	--	---	----	--	--	--	--	--	--	--

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
600050	中国联通	2017年4月5日	公告重大事项	7.47	2017年8月21日	8.22	3,310,800	21,878,319.03	24,731,676.00	-
601989	中国重工	2017年5月31日	公告重大事项	6.21	-	-	2,974,300	22,270,476.30	18,470,403.00	-
601088	中国神华	2017年6月5日	公告重大事项	22.29	-	-	644,462	11,104,934.81	14,365,057.98	-
600795	国电电力	2017年6月5日	公告重大事项	3.60	-	-	3,819,700	12,532,198.19	13,750,920.00	-
300104	乐视网	2017年4月17日	公告重大事项	30.68	-	-	397,000	15,720,489.31	12,179,960.00	-
600100	同方股份	2017年4月21日	公告重大事项	14.12	-	-	669,700	9,846,165.15	9,456,164.00	-
600485	信威集团	2017年6月27日	公告重大事项	14.59	-	-	565,100	9,841,334.83	8,244,809.00	-
601919	中远海控	2017年5月17日	公告重大事项	5.35	2017年7月26日	5.89	1,418,900	8,621,402.03	7,591,115.00	-
002252	上海莱士	2017年6月21日	公告重大事项	20.24	-	-	369,124	7,703,742.10	7,471,069.76	-
000503	海虹控股	2017年5月11日	公告重大事项	24.93	-	-	267,200	13,590,892.18	6,661,296.00	-
601727	上海电气	2017年6月22日	公告重大事项	7.57	2017年7月3日	7.54	829,267	6,129,638.32	6,277,551.19	-
000100	TCL集团	2017年6月2日	公告重大事项	3.43	2017年7月26日	3.72	1,723,600	6,128,388.54	5,911,948.00	-
002426	胜利精密	2017年1月16日	公告重大事项	7.68	-	-	643,200	6,112,772.00	4,939,776.00	-
600666	奥瑞德	2017年5月31日	公告重大事项	17.40	-	-	273,760	4,944,062.94	4,763,424.00	-
600959	江苏有线	2017年6月19日	公告重大事项	10.57	-	-	409,000	4,412,043.44	4,323,130.00	-
002049	紫光国芯	2017年6月15日	公告重大事项	30.82	-	-	136,877	4,654,520.30	4,218,549.14	-
601872	招商轮船	2017年5月2日	公告重大事项	5.16	-	-	794,400	4,416,255.71	4,099,104.00	-
600654	*ST	2017年6月	公告重	13.48	-	-	289,400	5,487,780.00	3,901,112.00	-

	中安	月7日	大事项								
601608	中信重工	2017年4月19日	公告重大事项	5.54	2017年7月26日	5.26	508,300	2,988,580.75	2,815,982.00	-	
002129	中环股份	2016年7月6日	公告重大事项	8.27	-	-	108,000	1,257,850.96	893,160.00	-	
600289	亿阳信通	2017年5月10日	公告重大事项	10.94	2017年8月18日	12.03	11,300	141,033.00	123,622.00	-	
002399	海普瑞	2017年6月29日	公告重大事项	20.23	-	-	3,700	76,334.78	74,851.00	-	
600657	信达地产	2017年2月20日	公告重大事项	5.76	2017年8月10日	6.19	12,500	74,500.00	72,000.00	-	
002505	大康农业	2017年3月13日	公告重大事项	3.50	-	-	6,600	23,298.00	23,100.00	-	

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有证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。

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无债券投资，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 2017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	385,455,751.62	-	-	-	385,455,751.62
结算备付金	401,336.01	-	-	-	401,336.01
存出保证金	1,105,781.85	-	-	-	1,105,781.85
交易性金融资产	-	-	-	2,390,644,174.12	2,390,644,174.12
应收利息	-	-	-	47,043.55	47,043.55
应收申购款	-	-	-	119,519.67	119,519.67

资产总计	386,962,869.48	-	-	2,390,810,737.34	2,777,773,606.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	177,543.61	177,543.61
应付赎回款	-	-	-	382,620,048.43	382,620,048.43
应付管理人报酬	-	-	-	1,248,069.86	1,248,069.86
应付托管费	-	-	-	249,614.00	249,614.00
应付交易费用	-	-	-	1,674,181.04	1,674,181.04
其他负债	-	-	-	2,062,738.97	2,062,738.97
负债总计	-	-	-	388,032,195.91	388,032,195.91
利率敏感度缺口	386,962,869.48	-	-	2,002,778,541.43	2,389,741,410.91
上年度末 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

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，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 2017 年 06 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	2,390,644,174.12	100.04	3,468,423,417.91	93.76
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	2,390,644,174.12	100.04	3,468,423,417.91	93.76

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。		
	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）	
分析		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	120,256,819.10	178,896,873.21
	-5%	-120,256,819.10	-178,896,873.21

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 2,225,284,394.05 元（上年度末：3,399,869,921.81 元），属于第二层次的余额为人民币 153,179,820.07 元（上年度末：68,553,496.10 元），属于第三层次的余额 12,179,960.00 元（上年度末：无）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期转入第三层次公允价值的金额为 12,179,960.00 元。

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 2017 年 8 月 24 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	2,390,644,174.12	86.06
	其中：股票	2,390,644,174.12	86.06
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	385,857,087.63	13.89
7	其他各项资产	1,272,345.07	0.05
8	合计	2,777,773,606.82	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	5,631,729.00	0.24
B	采矿业	79,666,806.12	3.33

C	制造业	865,584,405.62	36.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,593,108.72	2.83
E	建筑业	108,018,993.86	4.52
F	批发和零售业	50,629,479.13	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	68,763,437.66	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,950,365.10	5.90
J	金融业	801,347,211.67	33.53
K	房地产业	124,420,734.07	5.21
L	租赁和商务服务业	20,456,355.16	0.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,254,087.03	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,578,100.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	26,975,362.28	1.13
S	综合	6,773,998.70	0.28
	合计	2,390,644,174.12	100.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

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	601318	中国平安	2,409,093	119,515,103.73	5.00
2	600036	招商银行	2,293,900	54,847,149.00	2.30
3	600519	贵州茅台	111,700	52,705,645.00	2.21
4	601166	兴业银行	2,772,035	46,736,510.10	1.96
5	000651	格力电器	1,079,600	44,447,132.00	1.86
6	000333	美的集团	1,006,500	43,319,760.00	1.81
7	600016	民生银行	5,257,700	43,218,294.00	1.81
8	601328	交通银行	6,223,600	38,337,376.00	1.60
9	000002	万科A	1,513,901	37,802,107.97	1.58
10	601398	工商银行	6,724,600	35,304,150.00	1.48
11	601668	中国建筑	3,354,300	32,469,624.00	1.36
12	600000	浦发银行	2,500,028	31,625,354.20	1.32
13	600030	中信证券	1,773,265	30,180,970.30	1.26

14	600887	伊利股份	1,351,900	29,187,521.00	1.22
15	601601	中国太保	848,063	28,723,893.81	1.20
16	601988	中国银行	7,563,400	27,984,580.00	1.17
17	600837	海通证券	1,825,810	27,113,278.50	1.13
18	002415	海康威视	825,975	26,678,992.50	1.12
19	601169	北京银行	2,705,500	24,809,435.00	1.04
20	600050	中国联通	3,310,800	24,731,676.00	1.03
21	600104	上汽集团	784,837	24,369,188.85	1.02
22	000858	五粮液	422,100	23,494,086.00	0.98
23	600900	长江电力	1,467,836	22,575,317.68	0.94
24	000725	京东方 A	5,325,500	22,154,080.00	0.93
25	601766	中国中车	2,180,300	22,064,636.00	0.92
26	601211	国泰君安	1,002,948	20,570,463.48	0.86
27	600276	恒瑞医药	378,831	19,165,060.29	0.80
28	601939	建设银行	3,034,000	18,659,100.00	0.78
29	601989	中国重工	2,974,300	18,470,403.00	0.77
30	000001	平安银行	1,909,247	17,927,829.33	0.75
31	600048	保利地产	1,602,794	15,979,856.18	0.67
32	601336	新华保险	305,976	15,727,166.40	0.66
33	601818	光大银行	3,713,500	15,039,675.00	0.63
34	601390	中国中铁	1,657,900	14,373,993.00	0.60
35	601088	中国神华	644,462	14,365,057.98	0.60
36	600518	康美药业	660,061	14,349,726.14	0.60
37	600028	中国石化	2,361,500	14,003,695.00	0.59
38	600015	华夏银行	1,501,112	13,840,252.64	0.58
39	600795	国电电力	3,819,700	13,750,920.00	0.58
40	600019	宝钢股份	1,993,952	13,379,417.92	0.56
41	601688	华泰证券	726,388	13,002,345.20	0.54
42	000063	中兴通讯	529,132	12,561,593.68	0.53
43	601186	中国铁建	1,038,600	12,494,358.00	0.52
44	002450	康得新	549,478	12,374,244.56	0.52
45	002304	洋河股份	141,700	12,300,977.00	0.51
46	300104	乐视网	397,000	12,179,960.00	0.51
47	000776	广发证券	680,800	11,743,800.00	0.49
48	001979	招商蛇口	527,355	11,264,302.80	0.47
49	601006	大秦铁路	1,334,600	11,197,294.00	0.47
50	600703	三安光电	552,500	10,884,250.00	0.46
51	000538	云南白药	115,842	10,871,771.70	0.45
52	600690	青岛海尔	678,015	10,204,125.75	0.43

53	600585	海螺水泥	448,800	10,201,224.00	0.43
54	600958	东方证券	692,300	9,629,893.00	0.40
55	600100	同方股份	669,700	9,456,164.00	0.40
56	002024	苏宁云商	828,200	9,317,250.00	0.39
57	600999	招商证券	531,400	9,150,708.00	0.38
58	601901	方正证券	915,400	9,089,922.00	0.38
59	601009	南京银行	808,400	9,062,164.00	0.38
60	600340	华夏幸福	262,900	8,828,182.00	0.37
61	600089	特变电工	844,786	8,726,639.38	0.37
62	600309	万华化学	304,040	8,707,705.60	0.36
63	002230	科大讯飞	216,200	8,626,380.00	0.36
64	600741	华域汽车	355,500	8,617,320.00	0.36
65	000423	东阿阿胶	118,228	8,499,410.92	0.36
66	002142	宁波银行	433,690	8,370,217.00	0.35
67	601857	中国石油	1,087,900	8,365,951.00	0.35
68	600485	信威集团	565,100	8,244,809.00	0.35
69	600660	福耀玻璃	311,800	8,119,272.00	0.34
70	601985	中国核电	1,038,500	8,110,685.00	0.34
71	600009	上海机场	216,897	8,092,427.07	0.34
72	601669	中国电建	1,020,700	8,083,944.00	0.34
73	601899	紫金矿业	2,337,700	8,018,311.00	0.34
74	000568	泸州老窖	155,894	7,885,118.52	0.33
75	002241	歌尔股份	408,100	7,868,168.00	0.33
76	300070	碧水源	418,111	7,797,770.15	0.33
77	601377	兴业证券	1,042,500	7,745,775.00	0.32
78	002456	欧菲光	422,815	7,682,548.55	0.32
79	601919	中远海控	1,418,900	7,591,115.00	0.32
80	601607	上海医药	261,536	7,553,159.68	0.32
81	300072	三聚环保	202,326	7,496,178.30	0.31
82	000166	申万宏源	1,338,110	7,493,416.00	0.31
83	002252	上海莱士	369,124	7,471,069.76	0.31
84	600886	国投电力	931,700	7,360,430.00	0.31
85	002236	大华股份	322,412	7,354,217.72	0.31
86	000069	华侨城A	730,000	7,343,800.00	0.31
87	002736	国信证券	547,080	7,248,810.00	0.30
88	000338	潍柴动力	547,800	7,230,960.00	0.30
89	002466	天齐锂业	132,700	7,212,245.00	0.30
90	600068	葛洲坝	631,171	7,094,362.04	0.30
91	000783	长江证券	737,800	6,986,966.00	0.29

92	600196	复星医药	223,599	6,929,333.01	0.29
93	600031	三一重工	851,500	6,922,695.00	0.29
94	300059	东方财富	572,248	6,878,420.96	0.29
95	600029	南方航空	780,900	6,793,830.00	0.28
96	000503	海虹控股	267,200	6,661,296.00	0.28
97	600010	宝钢股份	3,041,340	6,660,534.60	0.28
98	601888	中国国旅	219,394	6,612,535.16	0.28
99	601600	中国铝业	1,462,400	6,610,048.00	0.28
100	002008	大族激光	189,800	6,574,672.00	0.28
101	600637	东方明珠	299,836	6,497,446.12	0.27
102	600066	宇通客车	295,400	6,489,938.00	0.27
103	601788	光大证券	434,400	6,485,592.00	0.27
104	000625	长安汽车	445,100	6,418,342.00	0.27
105	600606	绿地控股	811,800	6,348,276.00	0.27
106	601727	上海电气	829,267	6,277,551.19	0.26
107	000839	中信国安	610,250	6,096,397.50	0.26
108	601099	太平洋	1,515,895	6,093,897.90	0.26
109	600893	航发动力	221,773	6,054,402.90	0.25
110	002594	比亚迪	121,009	6,044,399.55	0.25
111	601933	永辉超市	851,400	6,027,912.00	0.25
112	000413	东旭光电	536,600	6,020,652.00	0.25
113	601555	东吴证券	533,768	5,994,214.64	0.25
114	600535	天士力	144,165	5,988,614.10	0.25
115	601618	中国中冶	1,191,100	5,967,411.00	0.25
116	600383	金地集团	519,495	5,958,607.65	0.25
117	600522	中天科技	491,500	5,922,575.00	0.25
118	000100	TCL 集团	1,723,600	5,911,948.00	0.25
119	600406	国电南瑞	324,142	5,721,106.30	0.24
120	000768	中航飞机	307,890	5,677,491.60	0.24
121	300124	汇川技术	222,185	5,674,604.90	0.24
122	600705	中航资本	998,100	5,639,265.00	0.24
123	002673	西部证券	389,422	5,537,580.84	0.23
124	600109	国金证券	470,800	5,517,776.00	0.23
125	002475	立讯精密	188,600	5,514,664.00	0.23
126	600816	安信信托	405,440	5,509,929.60	0.23
127	000963	华东医药	110,830	5,508,251.00	0.23
128	002202	金风科技	355,898	5,505,742.06	0.23
129	600111	北方稀土	484,790	5,492,670.70	0.23
130	000895	双汇发展	230,100	5,464,875.00	0.23

131	601800	中国交建	339,600	5,396,244.00	0.23
132	002739	万达院线	104,497	5,326,212.09	0.22
133	600271	航天信息	253,200	5,226,048.00	0.22
134	600023	浙能电力	945,300	5,161,338.00	0.22
135	600570	恒生电子	109,884	5,129,385.12	0.21
136	600739	辽宁成大	278,800	5,026,764.00	0.21
137	601018	宁波港	878,889	4,965,722.85	0.21
138	002426	胜利精密	643,200	4,939,776.00	0.21
139	600352	浙江龙盛	517,800	4,934,634.00	0.21
140	600177	雅戈尔	482,892	4,886,867.04	0.20
141	601992	金隅股份	754,900	4,884,203.00	0.20
142	600547	山东黄金	168,700	4,880,491.00	0.20
143	000623	吉林敖东	213,010	4,875,798.90	0.20
144	601225	陕西煤业	689,502	4,874,779.14	0.20
145	600674	川投能源	489,500	4,806,890.00	0.20
146	000728	国元证券	393,100	4,803,682.00	0.20
147	600221	海航控股	1,486,800	4,787,496.00	0.20
148	600666	奥瑞德	273,760	4,763,424.00	0.20
149	300024	机器人	242,879	4,736,140.50	0.20
150	000793	华闻传媒	462,300	4,678,476.00	0.20
151	002065	东华软件	213,858	4,659,965.82	0.19
152	600018	上港集团	732,000	4,640,880.00	0.19
153	002508	老板电器	105,520	4,588,009.60	0.19
154	002044	美年健康	269,300	4,578,100.00	0.19
155	002007	华兰生物	124,057	4,528,080.50	0.19
156	600208	新湖中宝	1,001,000	4,504,500.00	0.19
157	600804	鹏博士	251,600	4,465,900.00	0.19
158	600115	东方航空	654,400	4,449,920.00	0.19
159	601111	中国国航	451,165	4,398,858.75	0.18
160	000157	中联重科	977,030	4,386,864.70	0.18
161	600415	小商品城	605,300	4,382,372.00	0.18
162	603993	洛阳钼业	864,200	4,372,852.00	0.18
163	000540	中天城投	626,800	4,356,260.00	0.18
164	600959	江苏有线	409,000	4,323,130.00	0.18
165	601998	中信银行	681,600	4,287,264.00	0.18
166	600085	同仁堂	122,000	4,265,120.00	0.18
167	600820	隧道股份	419,500	4,236,950.00	0.18
168	601198	东兴证券	245,346	4,229,765.04	0.18
169	002049	紫光国芯	136,877	4,218,549.14	0.18

170	600153	建发股份	323,000	4,176,390.00	0.17
171	000826	启迪桑德	117,099	4,112,516.88	0.17
172	002465	海格通信	381,800	4,100,532.00	0.17
173	601872	招商轮船	794,400	4,099,104.00	0.17
174	600436	片仔癀	67,100	4,095,784.00	0.17
175	000630	铜陵有色	1,440,900	4,092,156.00	0.17
176	600362	江西铜业	237,000	3,995,820.00	0.17
177	002310	东方园林	238,200	3,982,704.00	0.17
178	600170	上海建工	1,038,517	3,967,134.94	0.17
179	000709	河钢股份	944,600	3,957,874.00	0.17
180	600157	永泰能源	1,105,400	3,946,278.00	0.17
181	000876	新希望	474,900	3,903,678.00	0.16
182	600663	陆家嘴	165,080	3,902,491.20	0.16
183	600654	*ST中安	289,400	3,901,112.00	0.16
184	300017	网宿科技	321,104	3,875,725.28	0.16
185	002081	金螳螂	352,756	3,873,260.88	0.16
186	000009	中国宝安	478,030	3,867,262.70	0.16
187	000060	中金岭南	344,400	3,857,280.00	0.16
188	600489	中金黄金	383,800	3,849,514.00	0.16
189	600061	国投安信	246,500	3,833,075.00	0.16
190	002146	荣盛发展	386,800	3,817,716.00	0.16
191	600332	白云山	129,904	3,772,412.16	0.16
192	601229	上海银行	146,900	3,751,826.00	0.16
193	002027	分众传媒	272,000	3,742,720.00	0.16
194	601155	新城控股	200,900	3,724,686.00	0.16
195	002074	国轩高科	117,100	3,694,505.00	0.15
196	000425	徐工机械	979,300	3,672,375.00	0.15
197	601216	君正集团	750,600	3,670,434.00	0.15
198	600118	中国卫星	131,500	3,660,960.00	0.15
199	002500	山西证券	377,500	3,616,450.00	0.15
200	600682	南京新百	98,000	3,616,200.00	0.15
201	000750	国海证券	656,300	3,609,650.00	0.15
202	600297	广汇汽车	477,090	3,592,487.70	0.15
203	601633	长城汽车	268,100	3,563,049.00	0.15
204	600008	首创股份	535,988	3,526,801.04	0.15
205	600369	西南证券	627,700	3,521,397.00	0.15
206	300315	掌趣科技	431,351	3,519,824.16	0.15
207	600150	中国船舶	153,200	3,503,684.00	0.15
208	601333	广深铁路	754,200	3,408,984.00	0.14

209	300144	宋城演艺	161,496	3,370,421.52	0.14
210	000402	金融街	283,300	3,320,276.00	0.14
211	000559	万向钱潮	306,140	3,251,206.80	0.14
212	000792	盐湖股份	309,850	3,237,932.50	0.14
213	600688	上海石化	487,400	3,221,714.00	0.13
214	000686	东北证券	312,260	3,138,213.00	0.13
215	002195	二三四五	438,460	3,134,989.00	0.13
216	600498	烽火通信	123,000	3,118,050.00	0.13
217	600718	东软集团	199,600	3,103,780.00	0.13
218	600583	海油工程	496,700	3,099,408.00	0.13
219	000983	西山煤电	350,400	3,073,008.00	0.13
220	601117	中国化学	438,800	3,067,212.00	0.13
221	600060	海信电器	199,600	3,027,932.00	0.13
222	600373	中文传媒	128,300	3,016,333.00	0.13
223	300027	华谊兄弟	371,734	3,007,328.06	0.13
224	300033	同花顺	47,800	2,973,638.00	0.12
225	600649	城投控股	281,273	2,956,179.23	0.12
226	002411	必康股份	102,200	2,955,624.00	0.12
227	600704	物产中大	399,400	2,911,626.00	0.12
228	600895	张江高科	172,200	2,906,736.00	0.12
229	600827	百联股份	178,427	2,899,438.75	0.12
230	600256	广汇能源	696,700	2,884,338.00	0.12
231	000415	渤海金控	426,700	2,871,691.00	0.12
232	002385	大北农	456,025	2,868,397.25	0.12
233	000917	电广传媒	252,200	2,849,860.00	0.12
234	002183	怡亚通	329,900	2,847,037.00	0.12
235	601608	中信重工	508,300	2,815,982.00	0.12
236	600588	用友网络	162,798	2,787,101.76	0.12
237	600074	保千里	216,900	2,778,489.00	0.12
238	002470	金正大	363,500	2,737,155.00	0.11
239	000008	神州高铁	374,800	2,728,544.00	0.11
240	600376	首开股份	229,500	2,625,480.00	0.11
241	600919	江苏银行	282,400	2,623,496.00	0.11
242	601718	际华集团	293,000	2,575,470.00	0.11
243	600038	中直股份	55,500	2,540,235.00	0.11
244	601866	中远海发	705,606	2,540,181.60	0.11
245	002558	世纪游轮	54,060	2,498,653.20	0.10
246	002602	世纪华通	68,500	2,483,810.00	0.10
247	002352	鼎泰新材	46,500	2,471,940.00	0.10

248	000959	首钢股份	352,900	2,466,771.00	0.10
249	600909	华安证券	241,600	2,437,744.00	0.10
250	002174	游族网络	76,598	2,432,752.48	0.10
251	601997	贵阳银行	153,400	2,425,254.00	0.10
252	002152	广电运通	288,900	2,400,759.00	0.10
253	600037	歌华有线	164,000	2,387,840.00	0.10
254	002555	三七互娱	92,700	2,370,339.00	0.10
255	600977	中国电影	124,600	2,332,512.00	0.10
256	300168	万达信息	159,300	2,317,815.00	0.10
257	000977	浪潮信息	133,300	2,308,756.00	0.10
258	600021	上海电力	190,300	2,300,727.00	0.10
259	000627	天茂集团	284,212	2,296,432.96	0.10
260	600737	中粮糖业	228,167	2,153,896.48	0.09
261	002714	牧原股份	77,300	2,104,106.00	0.09
262	000671	阳光城	360,100	2,095,782.00	0.09
263	600549	厦门钨业	96,200	2,067,338.00	0.09
264	002131	利欧股份	623,500	2,051,315.00	0.09
265	600372	中航电子	117,329	2,038,004.73	0.09
266	600685	中船防务	73,100	2,001,478.00	0.08
267	000738	中航动控	101,906	1,994,300.42	0.08
268	000938	紫光股份	32,500	1,986,400.00	0.08
269	601118	海南橡胶	349,700	1,986,296.00	0.08
270	000718	苏宁环球	337,400	1,977,164.00	0.08
271	002292	奥飞娱乐	116,315	1,965,723.50	0.08
272	600446	金证股份	111,400	1,958,412.00	0.08
273	600482	中国动力	77,400	1,957,446.00	0.08
274	601877	正泰电器	94,900	1,906,541.00	0.08
275	000156	华数传媒	127,471	1,900,592.61	0.08
276	601021	春秋航空	53,453	1,797,624.39	0.08
277	601375	中原证券	178,400	1,794,704.00	0.08
278	002424	贵州百灵	94,200	1,776,612.00	0.07
279	300133	华策影视	155,420	1,740,704.00	0.07
280	601881	中国银河	143,400	1,700,724.00	0.07
281	002153	石基信息	71,200	1,618,376.00	0.07
282	000961	中南建设	247,500	1,613,700.00	0.07
283	300251	光线传媒	195,700	1,602,783.00	0.07
284	601958	金钼股份	215,300	1,543,701.00	0.06
285	002299	圣农发展	102,100	1,518,227.00	0.06
286	600233	圆通速递	75,300	1,475,127.00	0.06

287	601163	三角轮胎	53,400	1,404,420.00	0.06
288	601611	中国核建	116,800	1,398,096.00	0.06
289	600871	石化油服	401,700	1,341,678.00	0.06
290	600926	杭州银行	89,600	1,330,560.00	0.06
291	601966	玲珑轮胎	53,400	1,197,762.00	0.05
292	603858	步长制药	16,700	1,196,388.00	0.05
293	603160	汇顶科技	10,900	1,093,270.00	0.05
294	000555	神州信息	64,300	1,073,810.00	0.04
295	600188	兖州煤业	85,600	1,047,744.00	0.04
296	002129	中环股份	108,000	893,160.00	0.04
297	601127	小康股份	39,700	792,015.00	0.03
298	002797	第一创业	85,700	789,297.00	0.03
299	002831	裕同科技	9,800	735,000.00	0.03
300	002841	视源股份	9,900	734,778.00	0.03
301	002839	张家港行	44,200	694,824.00	0.03
302	600289	亿阳信通	11,300	123,622.00	0.01
303	603806	福斯特	2,800	89,628.00	0.00
304	002399	海普瑞	3,700	74,851.00	0.00
305	600657	信达地产	12,500	72,000.00	0.00
306	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
307	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
308	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
309	002505	大康农业	6,600	23,100.00	0.00
310	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
311	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
312	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
313	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
314	600879	航天电子	2,000	17,580.00	0.00
315	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
316	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
317	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
318	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
319	002268	卫士通	20	336.40	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	600019	宝钢股份	17,323,599.40	0.47
2	002456	欧菲光	12,980,397.90	0.35
3	000538	云南白药	12,787,760.00	0.35
4	002415	海康威视	7,509,294.00	0.20
5	601727	上海电气	7,410,117.39	0.20
6	600522	中天科技	6,999,345.00	0.19
7	000540	中天城投	6,931,610.32	0.19
8	601992	金隅股份	6,330,203.00	0.17
9	002508	老板电器	6,063,920.20	0.16
10	600663	陆家嘴	6,060,522.20	0.16
11	000425	徐工机械	5,291,343.00	0.14
12	002044	美年健康	5,260,970.00	0.14
13	000100	TCL 集团	5,055,899.00	0.14
14	000415	渤海金控	4,971,169.00	0.13
15	600436	片仔癀	4,701,382.50	0.13
16	600649	城投控股	4,687,524.60	0.13
17	601229	上海银行	4,568,358.00	0.12
18	600682	南京新百	4,480,660.00	0.12
19	601988	中国银行	4,039,364.00	0.11
20	600021	上海电力	3,698,015.20	0.10

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	601318	中国平安	83,886,943.97	2.27
2	601166	兴业银行	40,090,774.95	1.08
3	600036	招商银行	39,354,767.38	1.06
4	600519	贵州茅台	38,253,121.76	1.03
5	600016	民生银行	32,269,631.00	0.87
6	000651	格力电器	29,041,129.00	0.79
7	601328	交通银行	28,327,859.00	0.77
8	000333	美的集团	28,191,417.20	0.76
9	000002	万科A	25,563,227.72	0.69
10	601668	中国建筑	24,226,934.00	0.65

11	601398	工商银行	23,765,217.00	0.64
12	600000	浦发银行	23,675,359.65	0.64
13	600030	中信证券	22,320,669.00	0.60
14	600887	伊利股份	20,050,387.00	0.54
15	600837	海通证券	20,047,756.36	0.54
16	601169	北京银行	18,390,056.00	0.50
17	601601	中国太保	18,376,394.00	0.50
18	002456	欧菲光	17,873,100.38	0.48
19	600900	长江电力	16,316,421.00	0.44
20	000858	五粮液	16,305,878.97	0.44

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	301,981,782.98
卖出股票收入（成交）总额	1,702,911,817.76

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

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 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,105,781.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	47,043.55
5	应收申购款	119,519.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,272,345.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
957	2,256,571.55	2,152,180,392.58	99.66%	7,358,579.87	0.34%

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	395,691.99	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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 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	3,698,278,530.41
本报告期基金总申购份额	3,687,985.50
减：本报告期基金总赎回份额	1,542,427,543.46
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,159,538,972.45

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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，基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门均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	
国泰君安	2	699,536,173.15	35.12%	651,478.92	37.87%	-
中信证券	2	534,393,935.04	26.83%	497,679.70	28.93%	-
方正证券	2	435,694,223.99	21.87%	275,054.18	15.99%	-
海通证券	2	301,902,535.94	15.16%	281,162.81	16.34%	-
兴业证券	2	20,464,621.43	1.03%	14,966.04	0.87%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	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。

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	
	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
国泰君安	-	-	19,900,000.00	59.05%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	4,820,887.50	100.00%	8,800,000.00	26.11%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	5,000,000.00	14.84%	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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参加中国农业银行股份有限公司 2017 年基金交易费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 1 日
2	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（2017 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 19 日
3	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 21 日

4	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 3 月 28 日
5	国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 4 月 22 日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 5 月 8 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170523-20170627	661,198,823.05	-	548,596,507.00	112,602,316.05	5.21%
	2	20170101-20170630	2,967,471,029.59	-	927,892,953.06	2,039,578,076.53	94.45%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保沪深 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.gsfunds.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日