

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  
2018 年年度报告

2018 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：2019 年 3 月 30 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 2019 年 3 月 29 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 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	12
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	43
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	43
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
8.13 投资组合报告附注 .....	43
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	44
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
11.4 基金投资策略的改变 .....	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
11.8 其他重大事件 .....	47
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
13.1 备查文件目录 .....	49
13.2 存放地点 .....	50
13.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF 联接
基金主代码	001241
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	428,595,898.41 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 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	贺倩
	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
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	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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-417,321.09	-975,896.11	-5,529,520.60
本期利润	-73,746,705.39	3,916,466.56	-39,058,055.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1814	0.0093	-0.0972
本期加权平均净值利润率	-35.61%	1.58%	-16.84%
本期基金份额净值增长率	-30.98%	1.56%	-15.72%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-253,543,583.58	-166,043,085.76	-180,420,824.05
期末可供分配基金份额利润	-0.5916	-0.4159	-0.4174
期末基金资产净值	175,052,314.83	236,194,590.12	251,864,367.59
期末基金份额净值	0.4084	0.5917	0.5826
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-59.16%	-40.83%	-41.74%

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	-12.42%	1.71%	-12.52%	1.74%	0.10%	-0.03%
过去六个月	-18.81%	1.47%	-19.15%	1.50%	0.34%	-0.03%
过去一年	-30.98%	1.41%	-31.85%	1.43%	0.87%	-0.02%
过去三年	-40.92%	1.39%	-43.35%	1.43%	2.43%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-59.16%	1.76%	-55.52%	1.82%	-3.64%	-0.06%

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

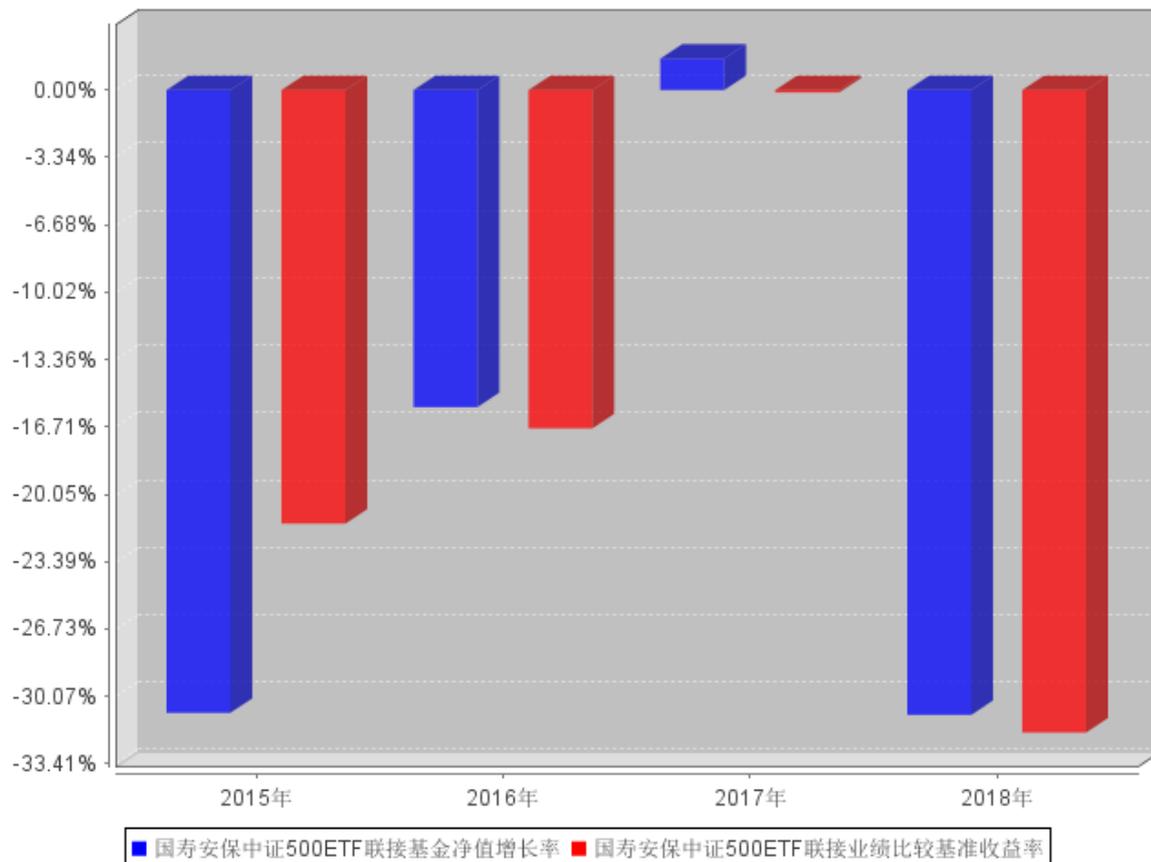
国寿安保中证500ETF联接基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

国寿安保中证500ETF联接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

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，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 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 43 只公募基金和部分资产管理计划，公司管理资产总规模为 2017.49 亿元，其中公募基金管理规模 1570.15 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	8 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金及国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.4084 元；本报告期基金份额净值增长率为 -30.98%，业绩比较基准收益率为-31.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2018 年全年，权益市场继续大幅调整，主要指数中，沪深 300 指数全年下跌 25.31%，创业板指下跌 28.65%，中证 500 指数全年下跌 33.32%，大盘股表现优与成长股。

展望 2019 年全年，贸易摩擦趋缓和，政策整体来看对资本市场友好，融资环境有望大幅改善，中央高层重视资本市场多层次发展的多重利好条件下，权益市场继续大幅下跌的可能性已经很低，机遇大于风险。2018 年底主要指数整体市盈率处于历史估值底部附近，配置价值突出。投资方向上，主线应该继续围绕着科技强国的思路进行，先进制造、5G、半导体、自主可控等子版块中一批有着核心技术的公司正在崛起，将成为全年的投资重点。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务的开展情况，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主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、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债金融估值中心有限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和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金报告期内未进行利润分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

#### **4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2019)审字第 61090605_A9 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过</p>

	<p>程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据</p>

	<p>获取的审计证据,就可能对国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	黄悦栋 郭燕
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	2019 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	14,931,050.01	12,478,491.84
结算备付金		-	-
存出保证金		123.89	2,876.83
交易性金融资产	7.4.7.2	160,471,693.67	224,366,939.52
其中: 股票投资		316,080.67	51,840.00
基金投资		160,155,613.00	224,315,099.52
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		2,529.20	-
应收利息	7.4.7.5	3,690.35	2,801.90
应收股利		-	-
应收申购款		2,605.01	2,463.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		175,411,692.13	236,853,573.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		30,215.91	219,121.11
应付管理人报酬		5,431.53	5,491.50
应付托管费		1,086.34	1,098.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,622.48	2,860.18
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	320,021.04	430,412.42
负债合计		359,377.30	658,983.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	428,595,898.41	399,195,478.34
未分配利润	7.4.7.10	-253,543,583.58	-163,000,888.22
所有者权益合计		175,052,314.83	236,194,590.12
负债和所有者权益总计		175,411,692.13	236,853,573.58

注:报告截止日 2018 年 12 月 31 日,基金份额净值人民币 0.4084 元,基金份额总额 428,595,898.41 份。

## 7.2 利润表

会计主体:国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至
-----	-----	-----------------------	----------------------------

		2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-73,456,582.67	4,385,144.58
1.利息收入		102,897.36	100,894.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	102,897.36	100,894.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-388,580.38	-686,790.30
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-201,928.57	-68,691.97
基金投资收益	7.4.7.13	-194,970.28	-618,305.78
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	8,318.47	207.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-73,329,384.30	4,892,362.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	158,484.65	78,677.27
<b>减：二、费用</b>		290,122.72	468,678.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	64,803.52	66,545.80
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,960.75	13,309.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	9,653.21	75,343.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.21	202,705.24	313,479.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-73,746,705.39	3,916,466.56
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-73,746,705.39	3,916,466.56

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	399,195,478.34	-163,000,888.22	236,194,590.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-73,746,705.39	-73,746,705.39
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）	29,400,420.07	-16,795,989.97	12,604,430.10
其中：1.基金申购款	203,834,110.90	-89,059,105.09	114,775,005.81
2.基金赎回款	-174,433,690.83	72,263,115.12	-102,170,575.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	428,595,898.41	-253,543,583.58	175,052,314.83
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	432,285,191.64	-180,420,824.05	251,864,367.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,916,466.56	3,916,466.56
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）	-33,089,713.30	13,503,469.27	-19,586,244.03
其中：1.基金申购款	86,609,631.75	-34,091,198.93	52,518,432.82
2.基金赎回款	-119,699,345.05	47,594,668.20	-72,104,676.85
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）	399,195,478.34	-163,000,888.22	236,194,590.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

王文英

韩占锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2015]485 号文《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2015 年 5 月 4 日至 2015 年 5 月 15 日向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2015)验字第 61090605\_A03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 5 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 412,943,746.75 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）。

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

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一

步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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

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

##### 7.4.6.2 增值税

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，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 1 月 1 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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

## 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	14,931,050.01	12,478,491.84
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	14,931,050.01	12,478,491.84

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	336,156.78	316,080.67	-20,076.11
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	238,931,577.00	160,155,613.00	-78,775,964.00
其他	-	-	-
合计	239,267,733.78	160,471,693.67	-78,796,040.11
项目	上年度末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	53,325.00	51,840.00	-1,485.00
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	229,780,270.33	224,315,099.52	-5,465,170.81
其他	-	-	-
合计	229,833,595.33	224,366,939.52	-5,466,655.81

### 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均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均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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,690.24	2,800.47
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	0.11	1.43
合计	3,690.35	2,801.90

### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,622.48	2,860.18
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,622.48	2,860.18

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	21.04	412.42
预提费用	320,000.00	430,000.00
-	-	-
合计	320,021.04	430,412.42

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	399,195,478.34	399,195,478.34
本期申购	203,834,110.90	203,834,110.90
本期赎回(以“-”号填列)	-174,433,690.83	-174,433,690.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	428,595,898.41	428,595,898.41

### 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	-166,043,085.76	3,042,197.54	-163,000,888.22
本期利润	-417,321.09	-73,329,384.30	-73,746,705.39
本期基金份额交易产生的变动数	-12,249,981.18	-4,546,008.79	-16,795,989.97
其中：基金申购款	-84,822,148.77	-4,236,956.32	-89,059,105.09
基金赎回款	72,572,167.59	-309,052.47	72,263,115.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-178,710,388.03	-74,833,195.55	-253,543,583.58

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	102,800.05
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	65.85	229.84
其他	31.46	179.32
合计	102,897.36	100,894.94

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-124,681.83	76,357.64
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-77,246.74	-145,049.61
合计	-201,928.57	-68,691.97

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,994,111.69	30,856,793.21
减：卖出股票成本总额	2,118,793.52	30,780,435.57
买卖股票差价收入	-124,681.83	76,357.64

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	14,570,000.00	48,448,800.00
减：现金支付申购款总额	7,816,148.51	25,394,504.95
减：申购股票成本总额	6,831,098.23	23,199,344.66
申购差价收入	-77,246.74	-145,049.61

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	5,218,601.48	67,183,639.12
减：卖出/赎回基金成本总额	5,413,571.76	67,801,944.90
基金投资收益	-194,970.28	-618,305.78

#### 7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期间无买卖债券投资收益。

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

无。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

本基金本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	8,318.47	207.45
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	8,318.47	207.45

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-73,329,384.30	4,892,362.67
——股票投资	-18,591.11	-83,429.23
——债券投资	-	-
——基金投资	-73,310,793.19	4,975,791.90
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-73,329,384.30	4,892,362.67

**7.4.7.19 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	118,315.55	78,499.54
其他	40,000.00	-
转换费收入	169.10	177.73
合计	158,484.65	78,677.27

### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	9,212.77	73,999.03
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	440.44	1,344.46
其中：申购费	375.52	559.51
赎回费	64.92	784.95
合计	9,653.21	75,343.49

### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	150,000.00	260,000.00
银行费用	2,705.24	3,479.67
其他	-	-
合计	202,705.24	313,479.67

## 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，本基金无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	基金管理人、注册登记机构、直销机构
农业银行	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“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
国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 （“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行证券交易。

### 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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	64,803.52	66,545.80
其中：支付销售机构的客户维护费	212,483.38	307,631.78

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,960.75	13,309.06

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金投资于

目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（金额为负时以零计）的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费为每日应计提的基金托管费

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	153,481,194.13	35.8100%	150,449,682.38	37.6900%

##### 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	14,931,050.01	102,800.05	12,478,491.84	100,485.78

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末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

于本报告期末，本基金持有 179,486,286.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 97.38%。（2017 年 12 月 31 日：本基金持有 169,486,286.00 份目标 ETF 基

金份额，占其总份额的比例为98.36%。)

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

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

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

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内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。

##### **7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），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。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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未持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,931,050.01	-	-	-	14,931,050.01
存出保证金	123.89	-	-	-	123.89
交易性金融资产	-	-	-	-160,471,693.67	160,471,693.67
应收证券清算款	-	-	-	2,529.20	2,529.20
应收利息	-	-	-	3,690.35	3,690.35
应收申购款	-	-	-	2,605.01	2,605.01
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,931,173.90	-	-	-160,480,518.23	175,411,692.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	30,215.91	30,215.91
应付管理人报酬	-	-	-	5,431.53	5,431.53
应付托管费	-	-	-	1,086.34	1,086.34
应付交易费用	-	-	-	2,622.48	2,622.48
其他负债	-	-	-	320,021.04	320,021.04
负债总计	-	-	-	359,377.30	359,377.30
利率敏感度缺口	14,931,173.90	-	-	-160,121,140.93	175,052,314.83

上年度末 2017 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	12,478,491.84	-	-	-	12,478,491.84
存出保证金	2,876.83	-	-	-	2,876.83
交易性金融资产	-	-	-	-224,366,939.52	224,366,939.52
应收利息	-	-	-	2,801.90	2,801.90
应收申购款	-	-	-	2,463.49	2,463.49
资产总计	12,481,368.67	-	-	-224,372,204.91	236,853,573.58
负债					
应付赎回款	-	-	-	219,121.11	219,121.11
应付管理人报酬	-	-	-	5,491.50	5,491.50
应付托管费	-	-	-	1,098.25	1,098.25
应付交易费用	-	-	-	2,860.18	2,860.18
其他负债	-	-	-	430,412.42	430,412.42
负债总计	-	-	-	658,983.46	658,983.46
利率敏感度缺口	12,481,368.67	-	-	-223,713,221.45	236,194,590.12

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%；持有的现金或者

到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。于 2018 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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	316,080.67	0.18	51,840.00	0.02
交易性金融资产-基金投资	160,155,613.00	91.49	224,315,099.52	94.97
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	160,471,693.67	91.67	224,366,939.52	94.99

#### 7.4.13.4.3.2 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 系数是根据组合的净值数据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（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	+5%	8,586,034.78	11,592,662.26
-5%	-8,586,034.78	-11,592,662.26	

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

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

#### (1) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 160,471,693.67 元（上年度末：224,324,045.52 元），无属于第二层次的余额（上年度末：42,894.00 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

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 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 2019 年 3 月 29 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	316,080.67	0.18
	其中：股票	316,080.67	0.18
2	基金投资	160,155,613.00	91.30
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,931,050.01	8.51
8	其他各项资产	8,948.45	0.01
9	合计	175,411,692.13	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	2,568.00	0.00
B	采矿业	8,876.00	0.01
C	制造业	161,527.74	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,826.00	0.00
E	建筑业	2,953.00	0.00
F	批发和零售业	26,945.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	11,879.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,714.93	0.04
J	金融业	4,804.00	0.00
K	房地产业	17,496.00	0.01
L	租赁和商务服务业	3,867.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,624.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	316,080.67	0.18

### 8.2.2 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港股通股票。

### 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	603444	吉比特	400	59,200.00	0.03
2	600872	中炬高新	300	8,838.00	0.01
3	600201	生物股份	380	6,308.00	0.00
4	600315	上海家化	200	5,460.00	0.00
5	603228	景旺电子	100	4,999.00	0.00
6	603658	安图生物	100	4,889.00	0.00
7	603883	老百姓	100	4,721.00	0.00
8	603816	顾家家居	100	4,500.00	0.00
9	600563	法拉电子	100	4,214.00	0.00
10	600848	上海临港	200	4,136.00	0.00
11	600885	宏发股份	180	4,060.80	0.00
12	600138	中青旅	300	3,867.00	0.00
13	603868	飞科电器	100	3,818.00	0.00
14	603515	欧普照明	130	3,623.10	0.00
15	600426	华鲁恒升	300	3,621.00	0.00
16	600600	青岛啤酒	100	3,486.00	0.00
17	603806	福斯特	130	3,484.00	0.00
18	600718	东软集团	300	3,465.00	0.00
19	600161	天坛生物	160	3,400.00	0.00
20	600260	凯乐科技	200	3,394.00	0.00
21	600256	广汇能源	900	3,384.00	0.00
22	600875	东方电气	400	3,156.00	0.00
23	600062	华润双鹤	260	3,143.40	0.00
24	600183	生益科技	300	3,018.00	0.00
25	600673	东阳光科	400	2,912.00	0.00
26	603369	今世缘	200	2,898.00	0.00
27	600729	重庆百货	100	2,830.00	0.00

28	600884	杉杉股份	200	2,584.00	0.00
29	600598	北大荒	300	2,568.00	0.00
30	600811	东方集团	700	2,562.00	0.00
31	600298	安琪酵母	100	2,523.00	0.00
32	600267	海正药业	300	2,517.00	0.00
33	600056	中国医药	200	2,514.00	0.00
34	600597	光明乳业	300	2,508.00	0.00
35	600325	华发股份	400	2,480.00	0.00
36	600642	申能股份	500	2,440.00	0.00
37	600572	康恩贝	400	2,372.00	0.00
38	601168	西部矿业	400	2,328.00	0.00
39	600511	国药股份	100	2,325.00	0.00
40	600435	北方导航	300	2,223.00	0.00
41	600122	宏图高科	600	2,178.00	0.00
42	600751	海航科技	800	2,168.00	0.00
43	600879	航天电子	400	2,164.00	0.00
44	600392	盛和资源	250	2,152.50	0.00
45	600536	中国软件	101	2,113.93	0.00
46	600755	厦门国贸	300	2,094.00	0.00
47	600967	内蒙一机	200	2,080.00	0.00
48	600808	马钢股份	600	2,076.00	0.00
49	600291	西水股份	200	2,058.00	0.00
50	600160	巨化股份	310	2,055.30	0.00
51	600500	中化国际	300	2,052.00	0.00
52	600388	龙净环保	200	2,030.00	0.00
53	600079	人福医药	200	2,028.00	0.00
54	600120	浙江东方	160	2,009.60	0.00
55	600022	山东钢铁	1,200	1,884.00	0.00
56	600335	国机汽车	300	1,872.00	0.00
57	600839	四川长虹	800	1,848.00	0.00
58	600086	东方金钰	400	1,844.00	0.00
59	600158	中体产业	200	1,778.00	0.00
60	600410	华胜天成	300	1,758.00	0.00
61	600060	海信电器	200	1,736.00	0.00
61	600216	浙江医药	200	1,736.00	0.00
62	600037	歌华有线	200	1,718.00	0.00
63	600643	爱建集团	200	1,698.00	0.00
64	600801	华新水泥	100	1,672.00	0.00
65	600759	洲际油气	700	1,652.00	0.00

66	600584	长电科技	200	1,648.00	0.00
67	600970	中材国际	300	1,641.00	0.00
68	600166	福田汽车	900	1,638.00	0.00
69	600460	士兰微	200	1,624.00	0.00
69	600645	中源协和	100	1,624.00	0.00
70	600623	华谊集团	200	1,616.00	0.00
71	600266	北京城建	200	1,584.00	0.00
72	600064	南京高科	200	1,576.00	0.00
73	600348	阳泉煤业	300	1,512.00	0.00
74	600787	中储股份	300	1,500.00	0.00
75	600655	豫园股份	201	1,487.40	0.00
76	600143	金发科技	300	1,485.00	0.00
77	600737	中粮糖业	200	1,472.00	0.00
78	600179	安通控股	220	1,463.00	0.00
79	603000	人民网	200	1,460.00	0.00
80	600835	上海机电	100	1,455.00	0.00
81	600418	江淮汽车	300	1,443.00	0.00
82	601000	唐山港	600	1,428.00	0.00
83	600717	天津港	200	1,414.00	0.00
84	600125	铁龙物流	200	1,400.00	0.00
85	600863	内蒙华电	600	1,386.00	0.00
86	600017	日照港	500	1,380.00	0.00
87	600282	南钢股份	400	1,368.00	0.00
88	600859	王府井	100	1,356.00	0.00
89	600993	马应龙	100	1,342.00	0.00
90	600380	健康元	200	1,334.00	0.00
91	600026	中远海能	300	1,332.00	0.00
92	600525	长园集团	300	1,314.00	0.00
93	600039	四川路桥	400	1,312.00	0.00
94	600329	中新药业	101	1,256.44	0.00
95	600978	宜华生活	300	1,230.00	0.00
96	600499	科达洁能	300	1,212.00	0.00
97	600664	哈药股份	300	1,185.00	0.00
98	600307	酒钢宏兴	600	1,146.00	0.00
99	600409	三友化工	200	1,144.00	0.00
100	603077	和邦生物	700	1,134.00	0.00
101	600823	世茂股份	300	1,128.00	0.00
102	601880	大连港	600	1,110.00	0.00
103	601717	郑煤机	200	1,106.00	0.00

104	600594	益佰制药	200	1,104.00	0.00
105	600094	大名城	300	1,095.00	0.00
106	600466	蓝光发展	200	1,076.00	0.00
107	600908	无锡银行	200	1,048.00	0.00
108	600557	康缘药业	100	1,028.00	0.00
109	600881	亚泰集团	300	993.00	0.00
110	600171	上海贝岭	100	934.00	0.00
111	600503	华丽家族	300	915.00	0.00
112	600575	皖江物流	400	852.00	0.00
113	601678	滨化股份	200	844.00	0.00
114	603766	隆鑫通用	200	818.00	0.00
115	600657	信达地产	200	786.00	0.00
116	600478	科力远	200	780.00	0.00
117	600614	鹏起科技	200	718.00	0.00
118	600750	江中药业	40	677.20	0.00
119	600240	华业资本	200	518.00	0.00
120	600393	粤泰股份	200	424.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	603444	吉比特	111,112.00	0.05
2	600201	生物股份	99,272.00	0.04
3	600426	华鲁恒升	69,889.00	0.03
4	600872	中炬高新	64,019.00	0.03
5	600256	广汇能源	63,475.00	0.03
6	600642	申能股份	62,052.00	0.03
7	600516	方大炭素	55,204.00	0.02
8	600298	安琪酵母	54,745.00	0.02
9	600879	航天电子	54,408.00	0.02
10	600584	长电科技	52,794.00	0.02
11	601168	西部矿业	52,749.00	0.02
12	600022	山东钢铁	52,716.00	0.02
13	600325	华发股份	52,636.00	0.02
14	600811	东方集团	52,189.00	0.02

15	600673	东阳光科	51,926.00	0.02
16	600315	上海家化	51,854.00	0.02
17	600176	中国巨石	51,112.00	0.02
18	600079	人福医药	50,801.00	0.02
19	600525	长园集团	50,789.80	0.02
20	600600	青岛啤酒	50,380.00	0.02

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	603444	吉比特	44,398.00	0.02
2	600516	方大炭素	39,527.00	0.02
3	600176	中国巨石	33,529.00	0.01
4	603019	中科曙光	27,463.00	0.01
5	600201	生物股份	24,941.00	0.01
6	600438	通威股份	19,894.00	0.01
7	600521	华海药业	19,285.00	0.01
8	600584	长电科技	19,236.00	0.01
9	601233	桐昆股份	19,013.00	0.01
10	600426	华鲁恒升	18,884.00	0.01
11	600004	白云机场	18,321.00	0.01
12	600256	广汇能源	17,896.00	0.01
13	603589	口子窖	17,640.00	0.01
14	600566	济川药业	17,433.00	0.01
15	600645	中源协和	17,336.00	0.01
16	601699	潞安环能	17,188.00	0.01
17	600642	申能股份	16,309.00	0.01
18	600525	长园集团	16,160.00	0.01
19	600079	人福医药	15,732.00	0.01
20	600298	安琪酵母	15,564.00	0.01

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	6,808,222.53
卖出股票收入（成交）总额	1,994,111.69

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国寿安保中证 500ETF	股票型	交易型开放式	国寿安保基金管理有限公司	160,155,613.00	91.49

### 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 8.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	123.89
2	应收证券清算款	2,529.20
3	应收股利	-
4	应收利息	3,690.35
5	应收申购款	2,605.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,948.45

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,293	99,835.99	279,153,992.96	65.13%	149,441,905.45	34.87%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,166,119.34	0.27%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0-10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	412,943,746.75
本报告期期初基金份额总额	399,195,478.34
本报告期期间基金总申购份额	203,834,110.90
减：本报告期期间基金总赎回份额	174,433,690.83
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	428,595,898.41

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

（1）2018 年 2 月 10 日，本基金管理人发布公告，王文英女士自 2018 年 2 月 7 日起任公司总经理助理；

（2）2018 年 3 月 3 日，本基金管理人发布公告，董瑞倩女士自 2018 年 2 月 28 日起任公司固定收益投资总监；

（3）2018 年 3 月 10 日，本基金管理人发布公告，张琦先生自 2018 年 3 月 7 日起任公司股票投资总监；

（4）2018 年 5 月 12 日，本基金管理人发布公告，王福新先生自 2018 年 5 月 9 日起任公司总经理助理；

（5）2018 年 7 月 14 日，本基金管理人发布公告，封雪梅女士因个人原因自 2018 年 7 月 6 日起离任公司总经理助理；

（6）2018 年 7 月 27 日，本基金管理人发布公告，王大朋先生自 2018 年 7 月 25 日起任公司总经理助理；

（7）2018 年 8 月 30 日，本基金管理人发布公告，石伟先生自 2018 年 8 月 29 日起任公司资产配置总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门聘任刘琳同志、李智同志为托管业

务部高级专家。

### 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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局《关于对国寿安保基金管理有限公司采取责令改正并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 3 个月。公司高度重视，制定相关整改措施，并持续进行全面整改。公司对行政监管措施决定书指出的问题已整改完毕并向监管部门报告了整改报告，整改已完成验收。本报告期内，基金管理人的高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人的托管业务部门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	
申万宏源	2	8,802,334.22	100.00%	6,436.88	100.00%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

### 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

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证 500ETF 联接基金更新招募说明书（摘要）（2018 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 1 月 15 日
2	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 年第 4 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 1 月 20 日

3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 1 月 22 日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通转换业务的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 2 月 7 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2017 年年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 3 月 27 日
6	国寿安保基金管理有限公司关于修订公司旗下权益类基金基金合同有关条款的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 3 月 29 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下部分基金赎回费的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 3 月 30 日
8	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 2018 年第 1 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 4 月 20 日
9	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购、定投费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 6 月 1 日
10	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书（摘要）（2018 年第 2 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 7 月 13 日
11	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 2018 年第 2 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 7 月 20 日
12	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 2018 年半年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 8 月 24 日
13	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 8 月 27 日
14	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年第 3 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 10 月 25 日
15	国寿安保部分基金新增阳光人寿为销售机构的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 12 月 14 日
16	国寿安保部分基金新增苏宁基金为销售机构的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 12 月 17 日
17	国寿安保基金管理有限公司新增北京蛋卷基金销售有限公司、北京君德汇富基金销售有限公司为销	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 12 月 19 日

	售机构并参加费率优惠活动的公告		
18	参加农业银行 2019 年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	2018 年 12 月 29 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180101~20180207, 20180327~20181231	82,357,107.56	24,030,281.18	0.00	106,387,388.74	24.82%
	2	20180101~20181231	150,449,682.38	153,481,194.13	150,449,682.38	153,481,194.13	35.81%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

13.1.2 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

13.1.3 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定媒体上披露的各项公告

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

## 13.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心  
2 号楼 11 层

## 13.3 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

13.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfoods.com.cn](http://www.gsfoods.com.cn)

13.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2019 年 3 月 30 日