

国寿安保沪深 300 交易型开放式 指数证券投资基金 2018 年年度报告（摘要）

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

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，普华永道中天会计师事务所（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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 19 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保沪深 300ETF
场内简称	国寿 300
基金主代码	510380
基金运作方式	契约型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 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	735,802,400.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 2 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
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

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

§ 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 1 月 19 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,087,955.13
本期利润	-54,864,262.37
加权平均基金份额本期利润	-0.2330
本期加权平均净值利润率	-27.11%
本期基金份额净值增长率	-23.58%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末
期末可供分配利润	-173,519,597.78
期末可供分配基金份额利润	-0.2358
期末基金资产净值	562,282,802.22
期末基金份额净值	0.7642

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。

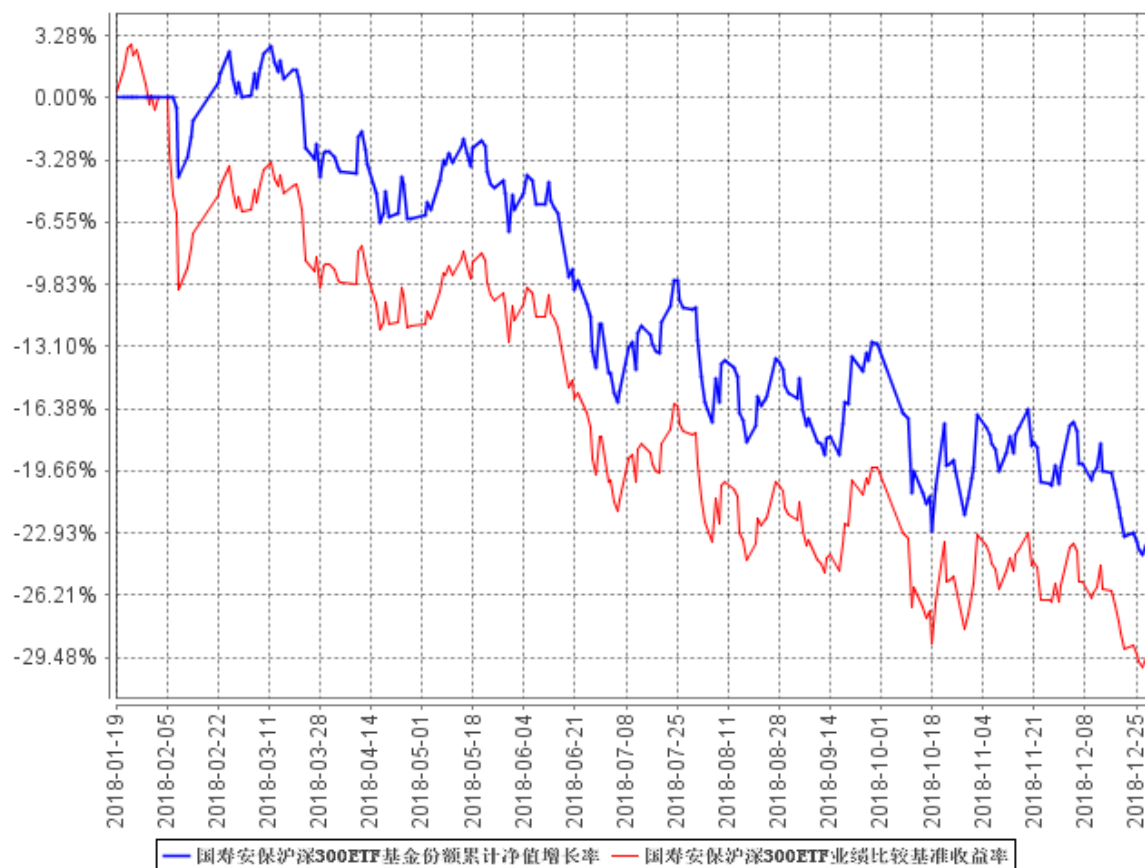
3.2 基金净值表现

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	-12.24%	1.62%	-12.45%	1.64%	0.21%	-0.02%
过去六个月	-13.22%	1.48%	-14.25%	1.50%	1.03%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	-23.58%	1.31%	-29.52%	1.37%	5.94%	-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

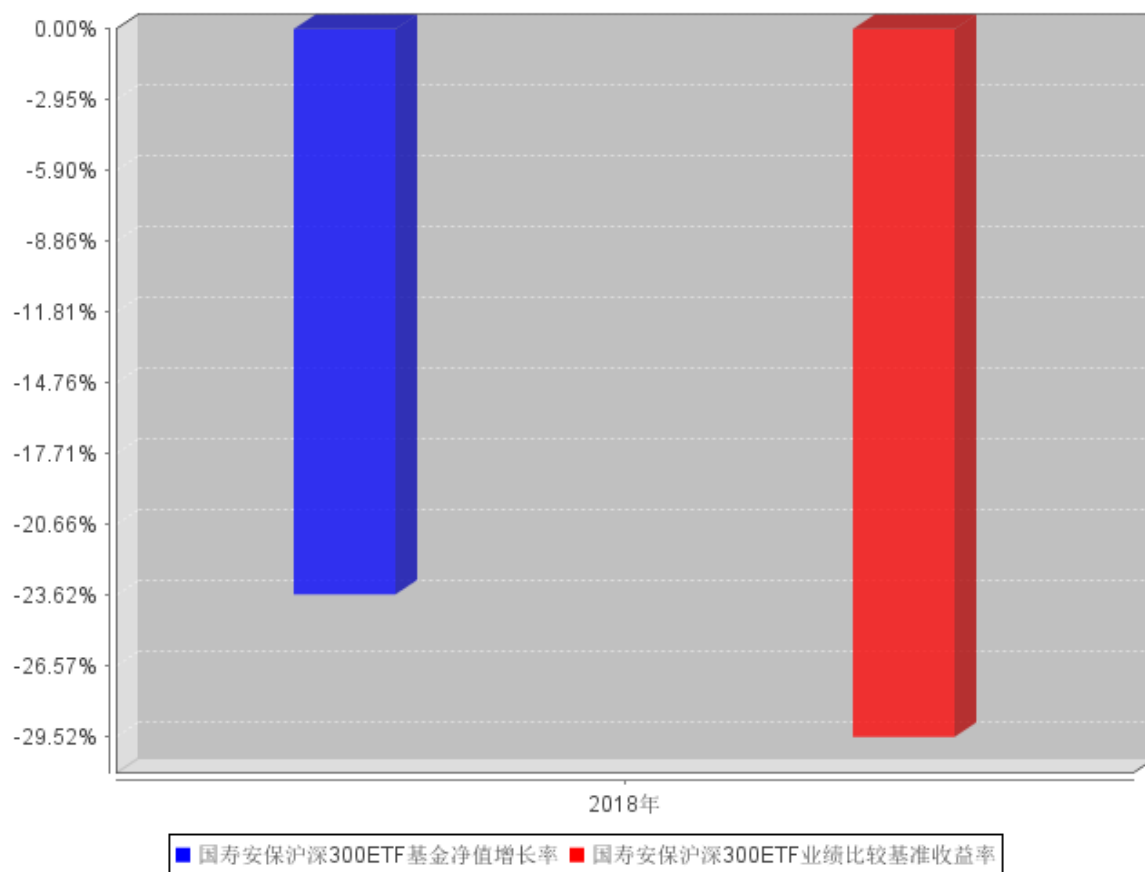
国寿安保沪深300ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于2018年01月19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2018年01月19日至2018年12月31日。

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

国寿安保沪深300ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 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	2018 年 1 月 19 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。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌等因素引起的成份股权重偏离。成分股调整、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 0.7642 元；本报告期基金份额净值增长率为

-23.58%，业绩比较基准收益率为-29.52%。

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。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由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 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合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于国寿安保基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日
资 产：	
银行存款	1,779,096.91
结算备付金	906,902.88
存出保证金	52,457.31
交易性金融资产	560,244,020.67
其中：股票投资	560,244,020.67
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	—
买入返售金融资产	—
应收证券清算款	—
应收利息	864.79
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	562,983,342.56
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日
负 债：	
短期借款	—
交易性金融负债	—
衍生金融负债	—
卖出回购金融资产款	—
应付证券清算款	—

应付赎回款	-
应付管理人报酬	247,152.50
应付托管费	49,430.50
应付销售服务费	-
应付交易费用	193,957.34
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	210,000.00
负债合计	700,540.34
所有者权益：	
实收基金	735,802,400.00
未分配利润	-173,519,597.78
所有者权益合计	562,282,802.22
负债和所有者权益总计	562,983,342.56

注：1.报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.7642 元，基金份额总额 735,802,400.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

7.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入	-52,848,634.58
1.利息收入	263,673.12
其中：存款利息收入	146,336.97
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	117,336.15
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-572,617.80
其中：股票投资收益	-2,962,736.66
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-

股利收益	2,390,118.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-52,776,307.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	236,617.34
减：二、费用	2,015,627.79
1.管理人报酬	941,808.58
2.托管费	188,361.70
3.销售服务费	-
4.交易费用	473,376.00
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	412,081.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-54,864,262.37
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-54,864,262.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)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）	294,802,400.00	-	294,802,400.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-54,864,262.37	-54,864,262.37
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）	441,000,000.00	-118,655,335.41	322,344,664.59
其中：1.基金申购款	618,000,000.00	-118,652,900.97	499,347,099.03
2.基金赎回款	-177,000,000.00	-2,434.44	-177,002,434.44
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）	735,802,400.00	-173,519,597.78	562,282,802.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2166 号《关于准予国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 294,788,000.00 元(含募集股票市值),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61090605_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 294,802,400.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,400.00 份基金份额。本基金的基金管理人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(以下简称“中国农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]19 号文审核同意,本基金 294,802,400.00 份基金份额于 2018 年 2 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(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、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)。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”）。国寿安保沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 19 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准

日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市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)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市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)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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 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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
活期存款	1,779,096.91
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：	1,779,096.91

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	613,020,327.91	560,244,020.67	-52,776,307.24
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		613,020,327.91	560,244,020.67	-52,776,307.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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
应收活期存款利息	389.92
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	448.91
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	25.96
合计	864.79

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
----	-------------------------

交易所市场应付交易费用	193,957.34
银行间市场应付交易费用	-
合计	193,957.34

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	160,000.00
应付指数使用费	50,000.00
合计	210,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	294,802,400.00	294,802,400.00
本期申购	618,000,000.00	618,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-177,000,000.00	-177,000,000.00
- 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	735,802,400.00	735,802,400.00

注：1. 本基金自 2017 年 10 月 13 日至 2018 年 1 月 12 日止期间公开发售，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 294,788,000.00 元(含募集股票市值)。根据《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 14,400.00 元在本基金成立后，折算为 14,400.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购与赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 2 月 6 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务和赎回业务自 2018 年 2 月 7 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,087,955.13	-52,776,307.24	-54,864,262.37
本期基金份额交易产生的变动数	1,126,546.71	-119,781,882.12	-118,655,335.41
其中：基金申购款	1,186,522.51	-119,839,423.48	-118,652,900.97
基金赎回款	-59,975.80	57,541.36	-2,434.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-961,408.42	-172,558,189.36	-173,519,597.78

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	131,817.94
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	13,613.80
其他	905.23
合计	146,336.97

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,551,379.69
股票投资收益——赎回差价收入	-411,356.97
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-2,962,736.66

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 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	62,893,688.54
减：卖出股票成本总额	65,445,068.23

买卖股票差价收入	-2,551,379.69
----------	---------------

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	177,002,434.44
减：现金支付赎回款总额	144,468,204.44
减：赎回股票成本总额	32,945,586.97
赎回差价收入	-411,356.97

7.4.7.13 债券投资收益

本基金于本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日无债券投资收益。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金于本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金于本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日无买卖衍生工具差价收入。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,390,118.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,390,118.86

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 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-52,776,307.24
——股票投资	-52,776,307.24
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-52,776,307.24

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-
其他	43,139.70
替代损益	193,477.64
合计	236,617.34

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	473,376.00
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-

赎回费	-
合计	473,376.00

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	100,000.00
上市费	85,000.00
其他	400.00
指数使用费	160,448.34
银行费用	6,233.17
合计	412,081.51

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

截至财务报表报出日，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
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	基金托管人
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
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
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（“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的联接基金
---	----------

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

本基金本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	941,808.58
其中：支付销售机构的客户维护费	—

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	188,361.70

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的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.1.3 销售服务费

无。

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日无与关联方进行银行间市场债券(含回购)交易。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.3.2 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	
	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	100,008,500.00	13.5918%
国寿安保沪深 300ETF 联接基金	618,000,000.00	83.9900%

7.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行	1,779,096.91	131,817.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间 2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日未进行利润分配。

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/增发的流通受限证券。。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	公告重大事项	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	467,765	8,122,983.19	7,488,917.65	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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	560,244,020.67	99.51
	其中：股票	560,244,020.67	99.51
2	基金投资	—	—
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	2,685,999.79	0.48
8	其他各项资产	53,322.10	0.01
9	合计	562,983,342.56	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	1,075,825.00	0.19
B	采矿业	20,404,465.16	3.63
C	制造业	219,394,756.78	39.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,192,884.16	3.06
E	建筑业	21,997,327.36	3.91
F	批发和零售业	9,333,903.14	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	17,863,458.55	3.18
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,555,625.66	3.48
J	金融业	192,745,384.53	34.28
K	房地产业	26,791,910.58	4.76
L	租赁和商务服务业	6,970,314.60	1.24
M	科学研究和技术服务业	464,132.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,324,064.45	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,168,570.70	0.56
R	文化、体育和娱乐业	1,961,398.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	560,244,020.67	99.64

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前十名股票投资明细

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	646,400	36,263,040.00	6.45
2	600519	贵州茅台	30,000	17,700,300.00	3.15
3	600036	招商银行	615,500	15,510,600.00	2.76
4	601166	兴业银行	743,700	11,110,878.00	1.98
5	000651	格力电器	287,200	10,250,168.00	1.82
6	000333	美的集团	276,800	10,202,848.00	1.81
7	601328	交通银行	1,639,500	9,492,705.00	1.69
8	600016	民生银行	1,481,300	8,487,849.00	1.51
9	600887	伊利股份	362,700	8,298,576.00	1.48
10	601288	农业银行	2,276,600	8,195,760.00	1.46

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票投资明细，应阅读登载于国寿安保基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	13,131,908.85	2.34
2	000333	美的集团	12,903,085.82	2.29
3	601318	中国平安	11,175,527.09	1.99
4	601288	农业银行	8,771,817.00	1.56
5	000002	万科A	8,229,510.15	1.46
6	600519	贵州茅台	7,992,907.00	1.42
7	000858	五粮液	7,389,391.02	1.31
8	002415	海康威视	6,981,744.34	1.24

9	000001	平安银行	6,276,386.62	1.12
10	000725	京东方 A	5,377,194.00	0.96
11	002304	洋河股份	5,145,410.93	0.92
12	600036	招商银行	4,741,498.98	0.84
13	000063	中兴通讯	3,719,859.40	0.66
14	002027	分众传媒	3,535,214.80	0.63
15	601166	兴业银行	3,415,555.00	0.61
16	002594	比亚迪	3,086,742.80	0.55
17	600016	民生银行	3,069,615.77	0.55
18	001979	招商蛇口	3,045,913.43	0.54
19	300059	东方财富	3,010,297.00	0.54
20	002142	宁波银行	2,982,862.00	0.53

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	1,658,444.00	0.29
2	002304	洋河股份	1,514,413.00	0.27
3	000651	格力电器	1,505,900.14	0.27
4	601318	中国平安	1,448,250.00	0.26
5	000333	美的集团	1,426,548.00	0.25
6	601099	太平洋	1,101,180.00	0.20
7	000858	五粮液	1,036,202.00	0.18
8	002739	万达院线	1,015,184.23	0.18
9	000623	吉林敖东	944,273.00	0.17
10	000002	万科 A	927,268.54	0.16
11	600519	贵州茅台	870,395.00	0.15
12	002415	海康威视	834,945.50	0.15
13	600036	招商银行	784,497.19	0.14
14	600804	鹏博士	762,570.00	0.14
15	000725	京东方 A	730,701.00	0.13
16	600820	隧道股份	715,617.00	0.13
17	000060	中金岭南	705,025.00	0.13
18	002500	山西证券	703,925.00	0.13

19	000063	中兴通讯	699,794.00	0.12
20	002074	国轩高科	675,247.00	0.12

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	367,121,496.37
卖出股票收入（成交）总额	62,893,688.54

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	52,457.31
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	864.79
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	53,322.10

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的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
407	1,807,868.30	719,039,700.00	97.72%	16,762,700.00	2.28%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国人寿保险股份有限公司	100,008,500.00	13.59%
2	李文锦	7,000,000.00	0.95%
3	何先君	2,000,000.00	0.27%
4	新疆中博投资有限公司	840,000.00	0.11%
5	李巍巍	705,000.00	0.10%
6	季鑫	501,000.00	0.07%
7	齐建山	390,000.00	0.05%
8	汪本立	300,000.00	0.04%
9	崔文悦	250,000.00	0.03%
10	雷军	237,000.00	0.03%
11	中国农业银行股份有限公司—国寿 安保沪深 300 交易型开放式指数证 券投资基金联接基	618,000,000.00	83.99%

注：表中前十名持有人为除国寿安保沪深 300ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 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	—	—

9.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 1 月 19 日）基金份额总额	294,802,400.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	618,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	177,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	735,802,400.00

§ 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

本基金于 2018 年 12 月 28 日发布公告，聘请普华永道中天会计师事务所（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	
国泰君安	2	153,686,909.51	35.74%	143,129.30	38.44%	-
海通证券	2	135,544,531.54	31.52%	126,230.72	33.90%	-
长城证券	2	96,126,510.35	22.35%	70,296.50	18.88%	-
兴业证券	2	44,657,233.51	10.39%	32,657.95	8.77%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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，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

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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,000,000,000.00	100.00%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：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	关于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额发售的提示性公告	上证报及公司网站	2018 年 1 月 8 日
2	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增长江证券为销售机构的公告	上证报及公司网站	2018 年 1 月 8 日
3	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金合同生效公告	上证报及公司网站	2018 年 1 月 20 日
4	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务公告	上证报及公司网站	2018 年 2 月 2 日
5	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上证报及公司网站	2018 年 2 月 2 日
6	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	上证报及公司网站	2018 年 2 月 7 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	上证报及公司网站	2018 年 2 月 7 日
8	国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	上证报及公司网站	2018 年 2 月 27 日
9	国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	上证报及公司网站	2018 年 4 月 20 日
10	国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	上证报及公司网站	2018 年 7 月 20 日
11	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告（摘要）	上证报及公司网站	2018 年 8 月 24 日
12	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（摘要）（2018 年第 1 号）	上证报及公司网站	2018 年 9 月 5 日
13	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	上证报及公司网站	2018 年 10 月 25 日

14	国寿安保基金管理有限公司旗下 基金变更会计师事务所公告	上证报及公司网站	2018 年 12 月 28 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	20180115~20181113	-	100,008,500.00	-	100,008,500.00	13.59%
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20181022~20181231	-	618,000,000.00	-	618,000,000.00	83.99%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

国寿安保基金管理有限公司

2019 年 3 月 30 日