

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

2018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：2018年8月24日

S 1重要提示

基金管理人的董事会、董事监事会对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2018年8月23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。

基金过往业绩并不代表未来表现。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摘要。

本半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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

S 2基金简介

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
报告期基金份额总额	406,935,479.84份
基金份额净值	不适用

S 2.1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	510650
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
报告期基金份额总额	406,935,479.84份
基金份额净值	不适用

S 2.2基金产品说明

投资目标	通过投资于在深交所上市的500只股票型基金，紧密跟踪标的指数，实现与标的指数收益相匹配的收益。
投资策略	本基金主要投资于在深交所上市的500只股票型基金，通过定期调整股票型基金的配置比例，力求获得与标的指数相匹配的收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及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。

S 2.3目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于在深交所上市的500只股票型基金，通过定期调整股票型基金的配置比例，力求获得与标的指数相匹配的收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益及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。

S 2.4基本信息

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
住所	北京市朝阳区	北京市东城区
办公地址	北京市朝阳区	北京市东城区
信息披露负责人	董晓华	王伟伟
联系电话	010-58050744	010-66060021
电子邮箱	publi@sfunds.com.cn	lgxpxj@china.com
客户服务电话	4008-258-258	4008-258-258
传真	010-50850776	010-68121816

S 2.5信息披露方式

基金半年度报告正本的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人处

S 3主要财务指标和基金净值表现

S 3.1主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

本期实现收益	-208,052.67
本期利润	-35,302,061.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0867
本期基金份额净值增长率	-14.99%
3.12报告期数据和指标	报告期(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0470
期末基金份额净值	204,695,769.26
期末基金份额总额	5,030,043.08份

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，计入费用后投资的实际收益水平将低于所列数值。

S 3.2基金净值表现

S 3.2.1基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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个月内使本基金的投资组合比例符合基金合同约定的有关投资范围和投资限制的有关规定。本基金在建仓结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2015年5月29日至2018年6月30日。

S 4管理人报告

S 4.1基金管理人及其基金经理的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1308号核准，于2013年10月24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6月30日，公司共管理44只开放式基金及部分特定资产管理计划，公司管理总资产规模为1,880.78亿元，其中公募基金管理规模为1,447.06亿元。

S 4.2基金经理助理简介

姓名 职务 任职日期 离任日期

李康	基金经理	2015年5月29日	8年
----	------	------------	----

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。

S 4.2.1对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人员严格遵守《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，以诚信、谨慎、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取最大利益。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。

S 4.3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执行交易公平原则，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》和公司公平交易相关制度。本报告期内，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

S 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

S 4.4.1报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内，本基金严格遵循“坚守合同，紧密跟踪”的指数组合。本基金为跟踪目标ETF实现对业绩比较基准的定期分析和不定期跟踪。本基金在投资操作上，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差的不利影响，从而达到半年度报告中对标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪半年度股票市场实际表现后，年初在地产业股带动下连续上涨，进入二月以后，在监管趋严和去杠杆压力下，叠加中美贸易摩擦等因素，权益市场大幅调整，主要指跌约20%。创业板指表现明显好于大盘，上半年创业板指数约8%，2017年表现良好的白马股回调明显，医药板是主要消费板块中指数不多表现亮眼的板块之一，但在6月份也遭遇回调。

截至目前，本基金的业绩表现略好于目标ETF的业绩表现。

S 4.4.2管理人对报告期内基金的业绩表现的说明

S 4.5管理人对本基金的基本情况的说明

S 4.5.1重要提示

基金管理人、基金托管人、中国农业银行股份有限公司

报送日期：2018年8月24日

S 4.5.2重要提示

基金管理人的董事会、董事监事会对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2018年8月23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。

基金过往业绩并不代表未来表现。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摘要。

本半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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

S 4.6.1重要提示

基金管理人、基金托管人、中国农业银行股份有限公司

报送日期：2018年8月24日

S 4.6.2重要提示

基金管理人的董事会、董事监事会对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2018年8月23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。

基金过往业绩并不代表未来表现。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摘要。

本半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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

S 4.6.3重要提示

基金管理人、基金托管人、中国农业银行股份有限公司

报送日期：2018年8月24日

S 4.6.4重要提示

基金管理人的董事会、董事监事会对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2018年8月23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。