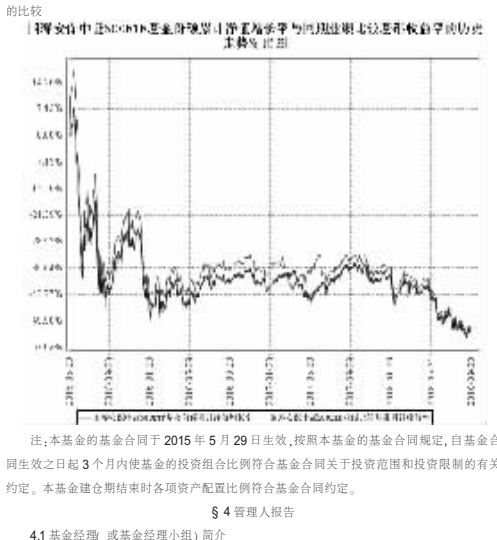


国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告



注:本基金的基金合同于 2015 年 5 月 29 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 3 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资产配置的约定。

指数证券投资基金(基金合同)及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产...

4.3 公平交易专项说明 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...

4.3.2 异常交易行为的专项说明 报告期内,本基金未发生法律法规对基金资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多的单边交易超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 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,紧密跟踪标的指数。本基金跟踪误差主要源自股票停牌复牌和成份权重调整等因素引起的成份股权重偏离。

4.5 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 1.0289 元;本报告期基金份额净值增长率为 -7.71%,业绩比较基准收益率为 -7.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 (Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例)

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例, 占比. Lists various asset categories like 权益投资, 其中:股票, 基金投资, etc.

注:任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。

2018年9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 报告送出日期:2018年10月25日

§ 1 重要提示 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。

§ 2 基金基本情况 基金名称:国寿安保中证 500ETF 场内简称:国寿 500 交易代码:510660

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) 1.本期已实现收益 -2,775,931.26

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明)

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers like 李康.

注:任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。

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists industry categories like 农林牧渔, 采矿业, etc.

5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 本基金本报告期末未投资港股。

5.3 报告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 (Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%))

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks.

5.4 报告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投资债券。

5.5 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债券投资明细 本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

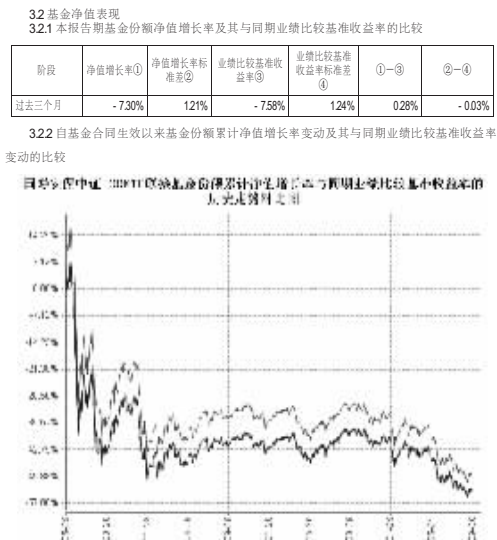
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 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。

5.11 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投资国债期货。

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年第三季度报告



注:任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。

指数证券投资基金(基金合同)及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产...

4.3 公平交易专项说明 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...

4.3.2 异常交易行为的专项说明 报告期内,本基金未发生法律法规对基金资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多的单边交易超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 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,紧密跟踪标的指数。本基金跟踪误差主要源自股票停牌复牌和成份权重调整等因素引起的成份股权重偏离。

4.5 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 0.4663 元;本报告期基金份额净值增长率为 -7.30%,业绩比较基准收益率为 -7.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 (Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例)

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例, 占比. Lists various asset categories like 权益投资, 其中:股票, 基金投资, etc.

注:任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。

2018年9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 报告送出日期:2018年10月25日

§ 1 重要提示 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。

§ 2 基金基本情况 基金名称:国寿安保中证 500ETF 场内简称:国寿 500 交易代码:510660

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) 1.本期已实现收益 -1,579,216.65

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明)

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers like 李康.

注:任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。

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists industry categories like 农林牧渔, 采矿业, etc.

5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 本基金本报告期末未投资港股。

5.3 报告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 (Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%))

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks.

5.4 报告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投资债券。

5.5 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债券投资明细 本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

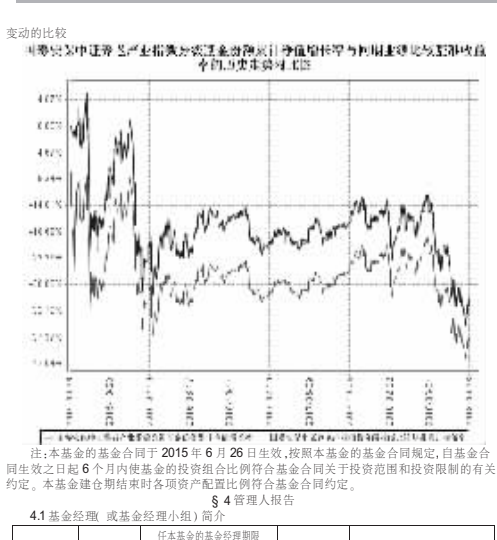
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 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。

5.11 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投资国债期货。

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

2018年第三季度报告



注:任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。

指数证券投资基金(基金合同)及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产...

4.3 公平交易专项说明 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...

4.3.2 异常交易行为的专项说明 报告期内,本基金未发生法律法规对基金资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多的单边交易超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 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,紧密跟踪标的指数。本基金跟踪误差主要源自股票停牌复牌和成份权重调整等因素引起的成份股权重偏离。

4.5 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 1.017 元;本报告期基金份额净值增长率为 -11.27%,业绩比较基准收益率为 -11.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

5 投资组合报告 5.1 报告期末基金资产组合情况 (Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例)

Table with 5 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例, 占比. Lists various asset categories like 权益投资, 其中:股票, 基金投资, etc.

注:任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。

2018年9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 报告送出日期:2018年10月25日

§ 1 重要提示 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。

§ 2 基金基本情况 基金名称:国寿安保中证养老产业指数基金 场内简称:国寿养老 交易代码:160801

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 主要财务指标 报告期(2018年7月1日至2018年9月30日) 1.本期已实现收益 -578,379.53

§ 4 管理人报告 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (Table with columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明)

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限, 说明. Lists fund managers like 李康.

注:任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。

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists industry categories like 农林牧渔, 采矿业, etc.

5.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合 本基金本报告期末未投资港股。

5.3 报告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 (Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%))

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks.

5.4 报告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投资债券。

5.5 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债券投资明细 本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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投资股指期货。

5.10 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。

5.11 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投资国债期货。

5.11 投资组合报告 5.11.1 报告期末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。

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元), 占比. Lists top 10 securities.

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成 (Table with columns: 序号, 名称, 金额(元))

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动 (Table with columns: 单位:份, 期初, 申购, 赎回, 期末)

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 报告期内基金管理人未投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 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

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过 20% 的区间, 期初, 期末, 持有份额, 占比

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 无。

§ 9 备查文件目录 9.1 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募集的文件

9.1.1 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募集的文件

9.1.2 国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

9.1.3 国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 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在指定媒体上披露的基金份额持有人大会决议

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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 号院鑫懋中心 2 号楼 11 层

9.3 查阅方式 9.3.1 投资人到本公司可免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品信息:www.gsfdns.com.cn

9.3.3 拨打本公司客户服务热线:4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司 2018 年 10 月 25 日

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注 5.12.1 报告期末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。

5.12.2 基金投资的前十名股票中,没有投资出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.12.3 其他资产构成 (Table with columns: 序号, 名称, 金额(元))

Table with 4 columns: 序号, 名称, 金额(元), 占比. Lists top 10 securities.

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告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情况。

5.12.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动 (Table with columns: 单位:份, 期初, 申购, 赎回, 期末)

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 报告期内基金管理人未投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息 8.1 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

Table with 4 columns: 投资者类别, 序号, 持有基金份额比例达到或超过 20% 的区间, 期初, 期末, 持有份额, 占比

8.2 影响投资者决策的其他重要信息 无。

§ 9 备查文件目录 9.1 中国证监会批准国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金募集的文件

9.1.1 中国证监会批准国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金募集的文件

9.1.2 国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同

9.1.3 国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金托管协议

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金在指定媒体上披露的基金份额持有人大会决议

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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 号院鑫懋中心 2 号楼 11 层

9.3 查阅方式 9.3.1 投资人到本公司可免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品信息:www.gsfdns.com.cn

9.3.3 拨打本公司客户服务热线:4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司 2018 年 10 月 25 日