

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

2018年度报告摘要

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

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人：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日复核了本报告的基本财务指标、净值表现、利润分配情况、财务计划报告、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未经审计，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，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01月01日起至12月31日止。

\$ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国寿安保中证500ETF
场内简称	国寿500
基金代码	510600
基金运作方式	契约型开放式(ETF)
基金合同生效日	2015年5月22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
报告期末基金资产总额	184,318,887.00元
基金份额净值	不适用
基金上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015年7月3日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求净值增长率最大化。
本基金完全被动地指数基金，采用完全复制法，即按成份股的在场内的权重比例构建指数化投资组合，并根据指数成份股其权重的变化适时调整。	
投资策略	
业绩比较基准	中证500指数
风险收益特征	本基金是股票基金,预期风险与预期收益高于混合基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是用复合型指数基金的指数的表现,具有与标的指数的相似的风险和收益特征。

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	张勇	傅静
联系电话	010-5805744	010-66060699
电子邮箱	publicsfund.com.cn	txyp@abcchina.com
客户服务电话	4009-258-258	95599
传真	010-5805776	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人网址：<http://www.gsfund.com.cn>

基金份额净值公告的披露媒体：基金管理人、基金托管人

3 \$ 3 主要财务指标、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
本期实现收益	-23,204,748.30	-12,155,154.18	-126,481,756.24
本期利润	75,924,415.41	5,702,879.68	94,764,889.74
加权平均基金份额本期利润	-0.4292	0.0307	-0.3473
本期份额净值增长率为	-32.58%	1.86%	-6.79%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额余额	-1,2674	-8,363	-8,065
期末基金份额净值	164,426,919.65	228,040,844.54	265,443,058.59

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，计入费用后投资者的实际收益水平将低于所列数字。

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

单位：人民币元

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去二个月	-13.28%	1.84%	-13.18%	1.84%	-0.10%	0.00%
过去六个月	-19.07%	1.57%	-20.12%	1.58%	0.13%	-0.01%
过去一年	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去三年	-42.85%	1.48%	-45.28%	1.55%	2.43%	-0.07%
自基金合同生效以来	1.88%	-57.76%	1.95%	-60.22%	-0.92%	-0.07%

注：本基金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，计入费用后投资者的实际收益水平将低于所列数字。

3.2.2 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

单位：人民币元

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去二个月	-13.28%	1.84%	-13.18%	1.84%	-0.10%	0.00%
过去六个月	-19.07%	1.57%	-20.12%	1.58%	0.13%	-0.01%
过去一年	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去三年	-42.85%	1.48%	-45.28%	1.55%	2.43%	-0.07%
自基金合同生效以来	1.88%	-57.76%	1.95%	-60.22%	-0.92%	-0.07%

注：本基金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，计入费用后投资者的实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3 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

单位：人民币元

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去二个月	-13.28%	1.84%	-13.18%	1.84%	-0.10%	0.00%
过去六个月	-19.07%	1.57%	-20.12%	1.58%	0.13%	-0.01%
过去一年	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去三年	-42.85%	1.48%	-45.28%	1.55%	2.43%	-0.07%
自基金合同生效以来	1.88%	-57.76%	1.95%	-60.22%	-0.92%	-0.07%

注：本基金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，计入费用后投资者的实际收益水平将低于所列数字。

3.2.4 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

单位：人民币元

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去二个月	-13.28%	1.84%	-13.18%	1.84%	-0.10%	0.00%
过去六个月	-19.07%	1.57%	-20.12%	1.58%	0.13%	-0.01%
过去一年	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去三年	-42.85%	1.48%	-45.28%	1.55%	2.43%	-0.07%
自基金合同生效以来	1.88%	-57.76%	1.95%	-60.22%	-0.92%	-0.07%

注：本基金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，计入费用后投资者的实际收益水平将低于所列数字。

3.2.5 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

单位：人民币元

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去二个月	-13.28%	1.84%	-13.18%	1.84%	-0.10%	0.00%
过去六个月	-19.07%	1.57%	-20.12%	1.58%	0.13%	-0.01%
过去一年	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去三年	-4					