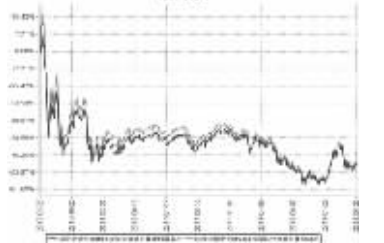


信息披露disclosure

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金2019年第二季度报告



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投资限制的约定。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。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李强	基金经理	2015年5月29日	-	9年	李强先生，博士研究生，2009年10月20日至12月12日担任于中国银河证券股份有限公司，任固定收益小组组长，2012年12月至2015年11月担任于广发基金管理有限公司，任固定收益部副经理，2015年11月加入国寿安保基金管理有限公司，任固定收益部副经理，现任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理，国寿安保中证500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 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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》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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和招募说明书约定的投资范围、投资比例、投资限制等违规行为。

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《证券投资基金管理人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。

4.3.2 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少的单边交易超过该证券当日成交量5%的情况。

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缩小跟踪误差，并定期跟踪分析误差产生的原因，及时调整跟踪误差管理方法。

截至本报告期末本基金份额净值为1.0610元；本报告期基金份额净值增长率为-10.63%，业绩比较基准收益率为-10.76%。

4.6 报告期内基金持有人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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	656,921,036.94	99.02
2	其中：股票	656,921,036.94	99.02
3	固定收益投资	-	-
4	其中：债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	4,366,423.23	0.66
11	其他资产	2,141,106.54	0.32
12	合计	663,427,562.71	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,366,596.00	1.10
B	采矿业	23,101,060.33	3.50
C	制造业	389,601,748.73	58.34
D	电力、热力、燃气及生产供应业	11,681,316.95	1.75
E	建筑业	24,973,304.44	3.75
F	交通运输、仓储和邮政业	22,190,713.31	3.33
G	信息、软件和信息技术服务业	2,519,307.69	0.38
H	金融业	63,314,489.05	9.55
I	房地产业	29,410,972.40	4.44
J	有色金属业	30,408,013.61	4.59
K	医药生物	9,020,091.60	1.36
L	轻工、纺织、商业	928,085.00	0.14
M	水利、环境和公共设施管理业	5,831,941.64	0.88
N	国防军工、医疗保健业	2,366,400.20	0.35
O	卫生和社会工作	3,328,790.40	0.50
P	文化、体育和娱乐业	13,636,821.58	2.05
Q	综合	9,001,221.00	1.36
合计		656,921,036.94	99.17

5.2.2 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。

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

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	宁德时代	691,688,923.87	449,428,489.92
2	比亚迪	458,179,164.61	3,566,201.04
3	五粮液	410,093,827.96	315,005,246.02
4	贵州茅台	-	-
5	招商银行	739,771,244.53	137,088,443.54

5.3.4 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

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	691,688,923.87	449,428,489.92
2	应收证券清算款	-	-
3	应收利息	17,292,231.04	666,564.29
4	应收申购款	-	-
5	其他应收款	-	-
6	待摊费用	-	-
7	其他	-	-
8	合计	18,281,164.91	11.14

5.3.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资

序号	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-
2	黄金期货	-	-
3	金融期货	-	-
4	其他贵金属	-	-
5	合计	-	-

5.3.8 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

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债期货	-	-
2	黄金期货	-	-
3	金融期货	-	-
4	其他贵金属	-	-
5	合计	-	-

5.3.10 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资产支持证券投资

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.12 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况
本基金本报告期末未持有股票。

5.3.14 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.16 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.18 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.20 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.22 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.24 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.26 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.28 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.30 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.32 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.34 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.36 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.38 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.40 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.42 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.44 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.46 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.48 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.50 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.52 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.54 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.56 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
2	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
3	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
4	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-
5	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金	-	-

5.3.58 基金投资的前十名权证超出基金合同规定的备选权证库之外的股票

序号	权证名称	公允价值(
----	------	-------