

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:2019年7月18日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人对本基金的财务指标、净值表现和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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告期内2019年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证500ETF
场内简称	国寿500
交易代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	624,318,697.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股的构成及其权重进行投资，以确保基金净值与标的指数的表现相一致。本基金将定期根据成份股的变动情况，以及成份股的调整规则，对基金的资产配置比例进行调整。
业绩比较基准	中证500指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险预期高且波动率高。混合型基金，证券投资与货币市场基金、本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险特征。本基金在投资范围内的股票投资比例不低于基金资产的80%。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)			
1.本期已实现收益		-13,000,496.69			
2.本期利润		-42,750,000.00			
3.加权平均基金份额本期利润		-0.750,-0.028			
4.期末基金资产净值		662,430,427.94			
5.期末基金份额净值		1.0101			

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,计价费用后投资人的实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金报告期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	净值增长率 <sup>①</sup>	净值增长率差 <sup>②</sup>	业绩比较基准收益率 <sup>③</sup>	业绩比较基准收益率差 <sup>④</sup>
过去三个月	-10.63%	1.82%	-10.76%	1.81%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

报告期内,本基金严格遵守基金合同,紧密追踪标的指数。

3.3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)			
1.本期已实现收益		4,747,182.02		1,431,724.25	
2.本期利润		4,564,266.00		779,798.73	
3.加权平均基金份额本期利润		0.0068		0.0031	
4.期末基金资产净值		750,652,260.62		139,038,974.09	
5.期末基金份额净值		1.0147			

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,计价费用后投资人的实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3 基金合同生效以来基金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

报告期内,本基金严格遵守基金合同,紧密追踪标的指数。

3.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金的管理人对外披露了黄力先生的辞职公告,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。

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	离任日期	说明
李旗	基金经理	2015年6月29日	-	9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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金的管理人对外披露了黄力先生的辞职公告,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。

4.3 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《证券投资基金行业公平交易制度指导意见(试行)》和公司制定的公平交易制度。本报告期内,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

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财产造成损失的异常交易行为;且不存在所持股票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股票当日成交量的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,紧密追踪标的指数。

5.1 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按长期国债利率品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有长期国债。

5.8 报告期末按短期国债利率品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有短期国债。

5.9 报告期末按回购利率品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有回购利率品种。

5.10 报告期末按信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有信用等级品种。

5.11 报告期末按融资融券等信用交易方式进行交易的债券组合

本基金本报告期末未持有融资融券等信用交易品种。

5.12 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权证投资

本基金本报告期末未持有权证。

5.13 报告期末按资产的账面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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.14 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贵金属投资

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.15 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保险及金融衍生品投资

本基金本报告期末未持有保险及金融衍生品。

5.16 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期权

本基金本报告期末未持有股票期权。

5.17 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期货期权

本基金本报告期末未持有期货期权。

5.18 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其他投资

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.19 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票据

本基金本报告期末未持有资产支持票据。

5.20 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.21 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存托凭证

本基金本报告期末未持有存托凭证。

5.22 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融资融券

本基金本报告期末未持有融资融券。

5.23 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权证及信用衍生品

本基金本报告期末未持有权证及信用衍生品。

5.24 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其他投资

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.25 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.26 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票据

本基金本报告期末未持有资产支持票据。

5.27 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存托凭证

本基金本报告期末未持有存托凭证。

5.28 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融资融券

本基金本报告期末未持有融资融券。

5.29 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权证及信用衍生品

本基金本报告期末未持有权证及信用衍生品。

5.30 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其他投资

本基金本报告期末未持有其他投资。

5.31 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.32 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票据

本基金本报告期末未持有资产支持票据。

5.33 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存托凭证

本基金本报告期末未持有存托凭证。

5.34 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融资融券

本基金本报告期末未持有融资融券。

5.35 报告期末按公允价值占基金资产净值比例