

国寿安保增金宝货币市场基金

2015 第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构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、基金管理人、基金服务机构根据本基金的基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

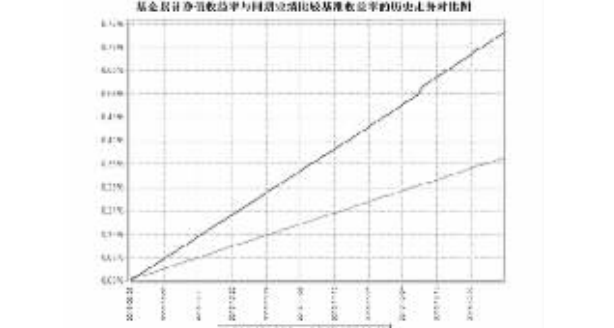
§2 基金产品概况	
基金名称	国寿安保增金宝货币
交易代码	010242
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年09月23日
报告期末基金总份额	262,011,460.23
投资目标	在严格控制风险和保持资产较高流动性的基础上,力争使基金份额净值增长率超过业绩比较基准。
投资策略	本基金管理人将深入研究国内外宏观经济走势,并密切跟踪国内政策、市场资金供求状况、利率和信用利差变化趋势,在严格控制风险的前提下,合理配置各类金融资产,动态调整投资组合,并视市场变化及时调整。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,069,289.20
2.本期利润	2,069,289.20
3.期末基金资产净值	262,011,460.23

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6921%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.3518%	0.0016%

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



注:本基金的基金合同于2015年9月23日生效,按照基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同“第十二部分(二)投资组合”(四)投资限制的有关约定。截至本报告期末,本基金建仓尚未结束。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
黄力	基金经理
任期日期	2015年9月23日
离任日期	-
证券从业年限	5年
说明	黄力先生,硕士,中国籍,曾任中国人寿资产管理分公司投资管理部、国寿安保资产管理分公司市场基金部基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》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。报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。
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。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量超过该证券当日成交量的5%的情形。
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2015年第四季度,国内经济继续偏弱,通胀水平保持低位徘徊。股票市场经历了三季度的大幅调整后,在四季度呈现企稳回升的态势。IPO+11月初宣布重启,年前夜按老办法发行之前提推的3批后28只新股。本基金作为新发基金,四季度主要为了封闭期。操作上,本基金结合自身规模波动的特性,保持较长的组合久期与较高的融资杠杆,维持较高的静态收益。同时,交易上积极进行资产交易,为组合创造超额收益。
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
本报告期内,本基金份额净值收益率为0.6921%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2016年一季度,宏观经济整体偏弱,通胀水平将会保持低位。货币政策将保持稳中偏紧,外汇、权益市场的走势可能会对影响资产价格走势的重要因素。新股发行方式的改变,减少了资金面紧张程度,从而可能使得货币基金的规模更加稳定。2月1日货币市场基金新管理办法将正式执行,为基金同收益基金缩小,投资中,我们将继续以保持资产流动性为第一要务,严格控制投资品到期时点,应对季节性规模波动。同时,我们密切注意债券交易性机会,我们的目标是在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。
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	
序号	项目
1	固定收益投资
2	权益投资
3	买入返售金融资产
4	银行存款和结算备付金合计
5	其他资产
6	合计

2.1 基金基本情况	
基金名称	国寿安保中证500ETF联接
基金代码	010241
交易代码	010241
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年09月23日
报告期末基金总份额	395,420,862.24
投资目标	通过主要投资于中证500交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数,力求实现基金份额净值增长率超越业绩比较基准,并视市场变化及时调整。
投资策略	本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金,紧密跟踪标的指数,力求实现基金份额净值增长率超越业绩比较基准,并视市场变化及时调整。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金,紧密跟踪标的指数,力求实现基金份额净值增长率超越业绩比较基准,并视市场变化及时调整。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

2.2 目标基金产品说明	
基金名称	国寿安保中证500ETF联接
基金代码	010241
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年09月23日
基金合同终止日	2015年09月23日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-14,771,706.96
2.本期利润	47,510,762.79
3.期末基金资产净值	395,420,862.24
4.期末基金份额净值	0.9993

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。

5.2 报告期债券回购融资情况	
序号	项目
1	报告期内债券回购融资余额
2	其中:买断式回购融资
3	其中:质押式回购融资
4	其中:买断式回购融资
5	其中:质押式回购融资

5.3 基金投资组合平均剩余期限基本情况	
项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合			
序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	19,962,841.21	7.63
	其中:政策性金融债	19,962,841.21	7.63
4	企业债券	—	—
5	含权短期融资券	79,964,216.54	30.52
6	中期票据	—	—
7	同业存单	—	—
8	其他	—	—
9	合计	99,947,057.75	38.15
10	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	—	—

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细					
序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071507008	15中债建信C008	200,000	19,996,004.41	7.63
2	011509662	15国债附息0704	200,000	19,991,764.22	7.63
3	011509662	15国债附息0704	200,000	19,989,631.61	7.63
4	041502653	15上银转债02	200,000	19,996,308.30	7.63
5	130215	13国债附息15	100,000	9,993,509.97	3.81
6	130223	13国债附息33	100,000	9,989,331.24	3.81

5.5.1 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离		
项目	偏离程度	
报告期内偏离度的绝对值平均值 $0.25\% \leq \text{绝对值} < 0.5\%$ 的次数	—	
报告期内偏离度的最高值	0.0866%	
报告期内偏离度的最低值	0.0000%	
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0225%	

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 投资组合报告附注

5.7.1 基金计价方法说明

5.7.2 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入溢价进行折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金份额净值始终保持1.00元。

5.7.3 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.7.4 报告期内本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,或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.7.4.1 其他资产构成

5.7 投资组合报告附注		
5.7.1 基金计价方法说明		
本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列价,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金份额净值始终保持1.00元。		
5.7.2 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。		
5.7.3 报告期内本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。		
5.7.4 其他资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	--
2	应收证券清算款	--
3	应收利息	1,992,444.22
4	其他应收款	--
5	其他流动资产	--
6	待摊费用	--
7	其他	--
8	合计	1,992,444.22

5.7.5 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。

5.6 开放式基金份额变动

5.7.5 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	
报告期末基金份额总额	310,246,763.98
报告期期初基金份额总额	2,075,446.87
减:报告期期间基金总申购份额	50,349,768.62
加:报告期期间基金总赎回份额	262,011,460.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况	
§8 备查文件目录	
8.1 备查文件目录	
8.1.1 中国证监会批准国寿安保增金宝货币市场基金募集的文件	
8.1.2 《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》	
8.1.3 《国寿安保增金宝货币市场基金托管协议》	
8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照	
8.1.5 报告期内国寿安保增金宝货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告	
8.1.6 中国证监会要求的其他文件	
8.2 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号院盈泰商务中心2号楼11层	
8.3 查阅方式	
8.3.1 营业时间内到本公司免费查阅	
8.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsunds.com.cn	
8.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询:4009-258-258	

国寿安保基金管理有限公司	
2016年1月20日	

2015 第四季度报告	
序号	项目
1	权益投资
2	其中:股票
3	固定收益投资
4	其中:债券
5	买入返售金融资产
6	银行存款和结算备付金合计
7	其他资产
8	合计

基金投资组合		证券从业年限	说明
序号	基金名称	备注	
1	李俊生, 博士研究生, 2010年10月至2012年12月担任中国金融期货交易所, 任股指期货首席研究员, 2013年1月至2015年11月担任上海期货交易所, 任股指期货首席研究员, 2015年11月至2016年10月担任国联基金资产管理有限公司任基金管理部 副总经理, 2016年10月至2019年6月担任国联基金资产管理有限公司任风控部 总经理, 2019年6月加入国联基金任 股指期货首席研究员	是	
2	600024交易型开放式股票证券投资基金		
3	600025交易型开放式股票证券投资基金		
4	600026交易型开放式股票证券投资基金		
5	600027交易型开放式股票证券投资基金		
6	600028交易型开放式股票证券投资基金		
7	600029交易型开放式股票证券投资基金		
8	600030交易型开放式股票证券投资基金		
9	600031交易型开放式股票证券投资基金		
10	600032交易型开放式股票证券投资基金		
11	600033交易型开放式股票证券投资基金		
12	600034交易型开放式股票证券投资基金		
13	600035交易型开放式股票证券投资基金		
14	600036交易型开放式股票证券投资基金		
15	600037交易型开放式股票证券投资基金		
16	600038交易型开放式股票证券投资基金		
17	600039交易型开放式股票证券投资基金		
18	600040交易型开放式股票证券投资基金		
19	600041交易型开放式股票证券投资基金		
20	600042交易型开放式股票证券投资基金		
21	600043交易型开放式股票证券投资基金		
22	600044交易型开放式股票证券投资基金		
23	600045交易型开放式股票证券投资基金		
24	600046交易型开放式股票证券投资基金		
25	600047交易型开放式股票证券投资基金		
26	600048交易型开放式股票证券投资基金		
27	600049交易型开放式股票证券投资基金		
28	600050交易型开放式股票证券投资基金		
29	600051交易型开放式股票证券投资基金		
30	600052交易型开放式股票证券投资基金		
31	600053交易型开放式股票证券投资基金		
32	600054交易型开放式股票证券投资基金		
33	600055交易型开放式股票证券投资基金		
34	600056交易型开放式股票证券投资基金		
35	600057交易型开放式股票证券投资基金		
36	600058交易型开放式股票证券投资基金		
37	600059交易型开放式股票证券投资基金		
38	600060交易型开放式股票证券投资基金		
39	600061交易型开放式股票证券投资基金		
40	600062交易型开放式股票证券投资基金		
41	600063交易型开放式股票证券投资基金		
42	600064交易型开放式股票证券投资基金		
43	600065交易型开放式股票证券投资基金		
44	600066交易型开放式股票证券投资基金		
45	600067交易型开放式股票证券投资基金		
46	600068交易型开放式股票证券投资基金		
47	600069交易型开放式股票证券投资基金		
48	600070交易型开放式股票证券投资基金		
49	600071交易型开放式股票证券投资基金		
50	600072交易型开放式股票证券投资基金		
51	600073交易型开放式股票证券投资基金		
52	600074交易型开放式股票证券投资基金		
53	600075交易型开放式股票证券投资基金		
54	600076交易型开放式股票证券投资基金		
55	600077交易型开放式股票证券投资基金		
56	600078交易型开放式股票证券投资基金		
57	600079交易型开放式股票证券投资基金		
58	600080交易型开放式股票证券投资基金		
59	600081交易型开放式股票证券投资基金		
60	600082交易型开放式股票证券投资基金		
61	600083交易型开放式股票证券投资基金		
62	600084交易型开放式股票证券投资基金		
63	600085交易型开放式股票证券投资基金		
64	600086交易型开放式股票证券投资基金		
65	600087交易型开放式股票证券投资基金		
66	600088交易型开放式股票证券投资基金		
67	600089交易型开放式股票证券投资基金		
68	600090交易型开放式股票证券投资基金		
69	600091交易型开放式股票证券投资基金		
70	600092交易型开放式股票证券投资基金		
71	600093交易型开放式股票证券投资基金		
72	600094交易型开放式股票证券投资基金		
73	600095交易型开放式股票证券投资基金		
74	600096交易型开放式股票证券投资基金		
75	600097交易型开放式股票证券投资基金		
76	600098交易型开放式股票证券投资基金		
77	600099交易型开放式股票证券投资基金		
78	600100交易型开放式股票证券投资基金		
79	600101交易型开放式股票证券投资基金		
80	600102交易型开放式股票证券投资基金		
81	600103交易型开放式股票证券投资基金		
82	600104交易型开放式股票证券投资基金		
83	600105交易型开放式股票证券投资基金		
84	600106交易型开放式股票证券投资基金		
85	600107交易型开放式股票证券投资基金		
86	600108交易型开放式股票证券投资基金		
87	600109交易型开放式股票证券投资基金		
88	600110交易型开放式股票证券投资基金		
89	600111交易型开放式股票证券投资基金		
90	600112交易型开放式股票证券投资基金		
91	600113交易型开放式股票证券投资基金		
92	600114交易型开放式股票证券投资基金		
93	600115交易型开放式股票证券投资基金		
94	600116交易型开放式股票证券投资基金		
95	600117交易型开放式股票证券投资基金		
96	600118交易型开放式股票证券投资基金		
97	600119交易型开放式股票证券投资基金		
98	600120交易型开放式股票证券投资基金		
99	600121交易型开放式股票证券投资基金		
100	600122交易型开放式股票证券投资基金		
101	600123交易型开放式股票证券投资基金		
102	600124交易型开放式股票证券投资基金		
103	600125交易型开放式股票证券投资基金		
104	600126交易型开放式股票证券投资基金		
105	600127交易型开放式股票证券投资基金		
106	600128交易型开放式股票证券投资基金		
107	600129交易型开放式股票证券投资基金		
108	600130交易型开放式股票证券投资基金		
109	600131交易型开放式股票证券投资基金		
110	600132交易型开放式股票证券投资基金		
111	600133交易型开放式股票证券投资基金		
112	600134交易型开放式股票证券投资基金		
113	600135交易型开放式股票证券投资基金		
114	600136交易型开放式股票证券投资基金		
115	600137交易型开放式股票证券投资基金		
116	600138交易型开放式股票证券投资基金		
117	600139交易型开放式股票证券投资基金		
118	600140交易型开放式股票证券投资基金		
119	600141交易型开放式股票证券投资基金		
120	600142交易型开放式股票证券投资基金		
121	600143交易型开放式股票证券投资基金		
122	600144交易型开放式股票证券投资基金		
123	600145交易型开放式股票证券投资基金		
124	600146交易型开放式股票证券投资基金		
125	600147交易型开放式股票证券投资基金		
126	600148交易型开放式股票证券投资基金		
127	600149交易型开放式股票证券投资基金		
128	600150交易型开放式股票证券投资基金		
129	600151交易型开放式股票证券投资基金		
130	600152交易型开放式股票证券投资基金		
131	600153交易型开放式股票证券投资基金		
132	600154交易型开放式股票证券投资基金		
133	600155交易型开放式股票证券投资基金		
134	600156交易型开放式股票证券投资基金		
135	600157交易型开放式股票证券投资基金		
136	600158交易型开放式股票证券投资基金		
137	600159交易型开放式股票证券投资基金		
138	600160交易型开放式股票证券投资基金		
139	600161交易型开放式股票证券投资基金		
140	600162交易型开放式股票证券投资基金		
141	600163交易型开放式股票证券投资基金		
142	600164交易型开放式股票证券投资基金		
143	600165交易型开放式股票证券投资基金		
144	600166交易型开放式股票证券投资基金		
145	600167交易型开放式股票证券投资基金		
146	600168交易型开放式股票证券投资基金		
147	600169交易型开放式股票证券投资基金		
148	600170交易型开放式股票证券投资基金		
149	600171交易型开放式股票证券投资基金		
150	600172交易型开放式股票证券投资基金		
151	600173交易型开放式股票证券投资基金		
152	600174交易型开放式股票证券投资基金		
153	600175交易型开放式股票证券投资基金		
154	600176交易型开放式股票证券投资基金		
155	600177交易型开放式股票证券投资基金		
156	600178交易型开放式股票证券投资基金		
157	600179交易型开放式股票证券投资基金		
158	600180交易型开放式股票证券投资基金		
159	600181交易型开放式股票证券投资基金		
160	600182交易型开放式股票证券投资基金		
161	600183交易型开放式股票证券投资基金		
162	600184交易型开放式股票证券投资基金		
163	600185交易型开放式股票证券投资基金		
164	600186交易型开放式股票证券投资基金		
165	600187交易型开放式股票证券投资基金		
166	600188交易型开放式股票证券投资基金		
167	600189交易型开放式股票证券投资基金		
168	600190交易型开放式股票证券投资基金		
169	600191交易型开放式股票证券投资基金		
170	600192交易型开放式股票证券投资基金		
171	600193交易型开放式股票证券投资基金		
172	600194交易型开放式股票证券投资基金		
173	600195交易型开放式股票证券投资基金		
174	600196交易型开放式股票证券投资基金		
175	600197交易型开放式股票证券投资基金		
176	600198交易型开放式股票证券投资基金		
177	600199交易型开放式股票证券投资基金		
178	600200交易型开放式股票证券投资基金		
179	600201交易型开放式股票证券投资基金		
180	600202交易型开放式股票证券投资基金		
181	600203交易型开放式股票证券投资基金		
182	600204交易型开放式股票证券投资基金		
183	600205交易型开放式股票证券投资基金		
184	600206交易型开放式股票证券投资基金		
185	600207交易型开放式股票证券投资基金		
186	600208交易型开放式股票证券投资基金		
187	600209交易型开放式股票证券投资基金		
188	600210交易型开放式股票证券投资基金		
189	600211交易型开放式股票证券投资基金		
190	600212交易型开放式股票证券投资基金		
191	600213交易型开放式股票证券投资基金		
192	600214交易型开放式股票证券投资基金		
193	600215交易型开放式股票证券投资基金		
194	600216交易型开放式股票证券投资基金		
195	600217交易型开放式股票证券投资基金		
196	600218交易型开放式股票证券投资基金		
197	600219交易型开放式股票证券投资基金		
198	600220交易型开放式股票证券投资基金		
199	600221交易型开放式股票证券投资基金		
200	600222交易型开放式股票证券投资基金		
201	600223交易型开放式股票证券投资基金		
202	600224交易型开放式股票证券投资基金		
203	600225交易型开放式股票证券投资基金		
204	600226交易型开放式股票证券投资基金		
205	600227交易型开放式股票证券投资基金		
206	600228交易型开放式股票证券投资基金		
207	600229交易型开放式股票证券投资基金		
208	600230交易型开放式股票证券投资基金		
209	600231交易型开放式股票证券投资基金		
210	600232交易型开放式股票证券投资基金		
211	600233交易型开放式股票证券投资基金		
212	600234交易型开放式股票证券投资基金		
213	600235交易型开放式股票证券投资基金		
214	600236交易型开放式股票证券投资基金		
215	600237交易型开放式股票证券投资基金		
216	600238交易型开放式股票证券投资基金		
217	600239交易型开放式股票证券投资基金		
218	600240交易型开放式股票证券投资基金		
219	600241交易型开放式股票证券投资基金		
220	600242交易型开放式股票证券投资基金		
221	600243交易型开放式股票证券投资基金		
222	600244交易型开放式股票证券投资基金		
223	600245交易型开放式股票证券投资基金		
224	600246交易型开放式股票证券投资基金		
225	600247交易型开放式股票证券投资基金		
226	600248交易型开放式股票证券投资基金		
227	600249交易型开放式股票证券投资基金		
228	600250交易型开放式股票证券投资基金		
229	600251交易型开放式股票证券投资基金		
230	600252交易型开放式股票证券投资基金		
231	600253交易型开放式股票证券投资基金		
232	600254交易型开放式股票证券投资基金		
233	600255交易型开放式股票证券投资基金		
234	600256交易型开放式股票证券投资基金		
235	600257交易型开放式股票证券投资基金		
236	600258交易型开放式股票证券投资基金		
237	600259交易型开放式股票证券投资基金		
238	600260交易型开放式股票证券投资基金		
239	600261交易型开放式股票证券投资基金		
240	600262交易型开放式股票证券投资基金		
241	600263交易型开放式股票证券投资基金		
242	600264交易型开放式股票证券投资基金		
243	600265交易型开放式股票证券投资基金		
244	600266交易型开放式股票证券投资基金		
245	600267交易型开放式股票证券投资基金		
246	600268交易型开放式股票证券投资基金		
247	600269交易型开放式股票证券投资基金		
248	600270交易型开放式股票证券投资基金		
249	600271交易型开放式股票证券投资基金		
250	600272交易型开放式股票证券投资基金		
251	600273交易型开放式股票证券投资基金		
252	600274交易型开放式股票证券投资基金		
253	600275交易型开放式股票证券投资基金		
254	600276交易型开放式股票证券投资基金		
255	600277交易型开放式股票证券投资基金		
256	600278交易型开放式股票证券投资基金		
257	600279交易型开放式股票证券投资基金		
258	600280交易型开放式股票证券投资基金		
259	600281交易型开放式股票证券投资基金		
260	600282交易型开放式股票证券投资基金		
261	600283交易型开放式股票证券投资基金		
262	600284交易型开放式股票证券投资基金		
263	600285交易型开放式股票证券投资基金		
264	600286交易型开放式股票证券投资基金		
265	600287交易型开放式股票证券投资基金		
266	600288交易型开放式股票证券投资基金		
267	600289交易型开放式股票证券投资基金		
268	600290交易型开放式股票证券投资基金		
269	600291交易型开放式股票证券投资基金		
270	600292交易型开放式股票证券投资基金		
271	600293交易型开放式股票证券投资基金		
272	600294交易型开放式股票证券投资基金		
273	600295交易型开放式股票证券投资基金		
274	600296交易型开放式股票证券投资基金		
275	600297交易型开放式股票证券投资基金		
276	600298交易型开放式股票证券投资基金		
277	600299交易型开放式股票证券投资基金		
278	600300交易型开放式股票证券投资基金		
279	600301交易型开放式股票证券投资基金		
280	600302交易型开放式股票证券投资基金		
281	600303交易型开放式股票证券投资基金		
282	600304交易型开放式股票证券投资基金		
283	600305交易型开放式股票证券投资基金		
284	600306交易型开放式股票证券投资基金		
285	600307交易型开放式股票证券投资基金		
286	600308交易型开放式股票证券投资基金		
287	600309交易型开放式股票证券投资基金		
288	600310交易型开放式股票证券投资基金		
289	600311交易型开放式股票证券投资基金		
290	600312交易型开放式股票证券投资基金		
291	600313交易型开放式股票证券投资基金		
292	600314交易型开放式股票证券投资基金		
293	600315交易型开放式股票证券投资基金		
294	600316交易型开放式股票证券投资基金		
295	600317交易型开放式股票证券投资基金		
296	600318交易型开放式股票证券投资基金		
297	600319交易型开放式股票证券投资基金		
298	600320交易型开放式股票证券投资基金		
299	600321交易型开放式股票证券投资基金		
300	600322交易型开放式股票证券投资基金		
301	600323交易型开放式股票证券投资基金		
302	600324交易型开放式股票证券投资基金		
303	600325交易型开放式股票证券投资基金		
304	600326交易型开放式股票证券投资基金		
305	600327交易型开放式股票证券投资基金		
306	600328交易型开放式股票证券投资基金		
307	600329交易型开放式股票证券投资基金		
308	600330交易型开放式股票证券投资基金		
309	600331交易型开放式股票证券投资基金		
310	600332交易型开放式股票证券投资基金		
311	600333交易型开放式股票证券投资基金		
312	600334交易型开放式股票证券投资基金		
313	600335交易型开放式股票证券投资基金		
314	600336交易型开放式股票证券投资基金		
315	600337交易型开放式股票证券投资基金		
316	600338交易型开放式股票证券投资基金		
317	600339交易型开放式股票证券投资基金		
318	600340交易型开放式股票证券投资基金		
319	600341交易型开放式股票证券投资基金		
320	600342交易型开放式股票证券投资基金		
321	600343交易型开放式股票证券投资基金		
322	600344交易型开放式股票证券投资基金		
323	600345交易型开放式股票证券投资基金		
324	600346交易型开放式股票证券投资基金		
325	600347交易型开放式股票证券投资基金		
326	600348交易型开放式股票证券投资基金		
327	600349交易型开放式股票证券投资基金		
328	600350交易型开放式股票证券投资基金		
329	600351交易型开放式股票证券投资基金		
330	600352交易型开放式股票证券投资基金		
331	600353交易型开放式股票证券投资基金		
332	600354交易型开放式股票证券投资基金		
333	600355交易型开放式股票证券投资基金		
334	600356交易型开放式股票证券投资基金		
335	600357交易型开放式股票证券投资基金		
336	600358交易型开放式股票证券投资基金		
337	600359交易型开放式股票证券投资基金		
338	600360交易型开放式股票证券投资基金		
339	600361交易型开放式股票证券投资基金		
340	600362交易型开放式股票证券投资基金		
341	600363交易型开放式股票证券投资基金		
342	600364交易型开放式股票证券投资基金		
343	600365交易型开放式股票证券投资基金		
344	600366交易型开放式股票证券投资基金		
345	600367交易型开放式股票证券投资基金		
346	600368交易型开放式股票证券投资基金		
347	600369交易型开放式股票证券投资基金		
348	600370交易型开放式股票证券投资基金		
349	600371交易型开放式股票证券投资基金		
350	600372交易型开放式股票证券投资基金		
351	600373交易型开放式股票证券投资基金		
352	600374交易型开放式股票证券投资基金		
353	600375交易型开放式股票证券投资基金		
354	600376交易型开放式股票证券投资基金		
355	600377交易型开放式股票证券投资基金		
356	600378交易型开放式股票证券投资基金		
357	600379交易型开放式股票证券投资基金		
358	600380交易型开放式股票证券投资基金		
359	600381交易型开放式股票证券投资基金		
360	600382交易型开放式股票证券投资基金		
361	600383交易型开放式股票证券投资基金		
362	600384交易型开放式股票证券投资基金		
363	600385交易型开放式股票证券投资基金		
364	600386交易型开放式股票证券投资基金		
365	600387交易型开放式股票证券投资基金		
366	600388交易型开放式股票证券投资基金		
367	600389交易型开放式股票证券投资基金		
368	600390交易型开放式股票证券投资基金		
369	600391交易型开放式股票证券投资基金		
370	600392交易型开放式股票证券投资基金		
371	600393交易型开放式股票证券投资基金		
372	600394交易型开放式股票证券投资基金		
373	600395交易型开放式股票证券投资基金		
374	600396交易型开放式股票证券投资基金		
375	600397交易型开放式股票证券投资基金		
376	600398交易型开放式股票证券投资基金		
377	600399交易型开放式股票证券投资基金		
378	600400交易型开放式股票证券投资基金		
379	600401交易型开放式股票证券投资基金		
380	600402交易型开放式股票证券投资基金		
381	600403交易型开放式股票证券投资基金		
382	600404交易型开放式股票证券投资基金		
383	600405交易型开放式股票证券投资基金		
384	600406交易型开放式股票证券投资基金		
385	600407交易型开放式股票		

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》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用基金资产,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损害基金份额持有人利益的行为。
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《证券投资基金管理公司公平

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构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、基金管理人、基金服务机构根据本基金的基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。
本报告中财务资料未经审计。
本报告自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	国寿安保中证500ETF联接
场内简称	国保500
基金代码	010560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年06月28日
报告期末基金总份额	342,318,687.00
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	本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制法,跟踪标的指数的表现,力求实现基金份额净值增长率超越业绩比较基准,并视市场变化及时调整。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,跟踪风险与跟踪误差下组合净值、债券型基金与货币市场基金。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、以及标的指数所代表的股票市场的类似风险收益特征。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

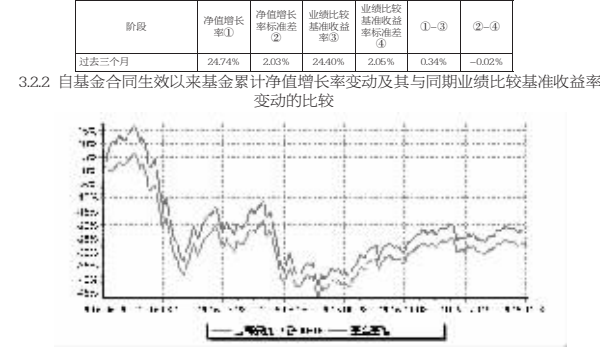
§3 主要财务指标和基金净值表现	
3.1 主要财务指标	
主要财务指标	报告期(2015年10月1日至2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-30,068,210.66
2.本期利润	102,499,039.64
3.期末基金资产净值	342,318,687.00
4.期末基金份额净值	1.0613

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。

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，计入费用后投资人的实际收益可能低于所列数字。

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



注:本基金的基金合同于2015年6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有关约定。本基金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6月29日至2015年12月31日。

§4 管理人报告	
4.1 基金经理(或基金经理小组)简介	
姓名	职务
李强	基金经理
任期日期	2015年06月28日
离任日期	-
证券从业年限	6年
说明	李强先生,博士研究生,2000年10月至2012年12月就职于中国银河证券股份有限公司,任量化分析经理;2013年12月至2015年11月就职于国寿安保基金管理有限公司,任量化研究员;2015年11月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理,现任国寿安保中证500ETF联接基金基金经理。李强先生持有基金从业资格,并具备中国证监会规定的基金从业资格。

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。本基金管理人,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。
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。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量超过该证券当日成交量的5%的情形。
4.4 报告期内基金的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长期停牌股票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克服跟踪误差和不利因素的影响。并且,逐日跟踪实际组合与标的指数的偏离,定期分析优化跟踪偏离度管理方案。
4.5 报告期内基金的投资表现
截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.0613元,累计份额净值为0.7229元。报告期内净值增长率为24.74%,同期业绩比较基准为24.40%。
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。
4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
经历三季度大幅下跌后,市场在四季度有所反弹。站在当前时点,在基本面探底的局面下,经济转型和改革将是驱动市场的主要因素。流动性宽松有限,且边际效用降低。整体是存量资金博弈的行情,未来市场将以结构性投资机会为主。同时,外围经济环境和汇率波动等因素影响,有可能加剧股市市场波动。
4.8 报告期内基金的投资表现
截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.0613元,累计份额净值为0.7229元。报告期内净值增长率为24.74%,同期业绩比较基准为24.40%。
4.9 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
无。
4.10 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明
无。

5.1 报告期末基金资产组合情况	
序号	项目
1	权益投资
2	其中:股票
3	固定收益投资
4	其中:债券
5	买入返售金融资产
6	银行存款和结算备付金合计
7	其他资产
8	合计

累引起的成份股权重偏离以 引起的偏离。 日历中赚和市场 因素的管理人采用量化分析手段， 以因素的影响。并且，逐日跟踪 仓位跟踪偏离度管理。	H 住宿和餐饮业	6,132.00	
	I 信息传输、软件和信息技术服务	344,602.02	
	J 金融业	46,704.00	
	K 房地产业	261,760.03	
	L 租赁和商务服务业	19,794.20	
	M 科学研究和技术服务业	16,164.50	
	N 水利、环境和公共设施管理业	20,695.60	
	O 教育、管理和基础设施服务	-	
	P 教育	-	
	Q 卫生和社会工作	3,765.16	
	R 文化、体育和娱乐业	88,506.00	
	S 综合	24,474.80	
	合计	7,280,473.23	

值为0.69133，累计份额净值
3.35%，同期业绩基准涨幅为

资产净值走势说明

资产净值走势图

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大
票投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)
1	000748	长城信息	46,200	1,140,216.00
2	002018	华信国际	36,500	1,087,010.00
3	000066	长信科技	65,000	712,411.00
4	002219	恒瑞医药	42,750	636,976.50
5	000075	百花潭	22,200	401,260.00

前公允价值投资资产,力争到最小程度。

报告

	占基金已发行净值的比例 (%)
7,900,473.23	2.88
7,900,473.23	2.88
230,230,234.03468	91.03
-	-
-	-
-	-
-	-
-	-
16,008,730.04	5.93
397,976.72	0.16
252,021,214.97	100.00

5.4 报告期末按券品种和分类的债券投资组合

本基金本报告期末未有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大

券投资组合

本基金本报告期末未有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大

产支持证券投资组合

本基金本报告期末未有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大

金属投资组合

本基金本报告期末未有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大

证投资组合

本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金持有的股指期货合约和

注:本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股票投资明细
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
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小