

## 国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

## [2015] 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  
报告截止日:2015年12月31日

基金托管人对本报告书内容承担复核责任,并对其内容的真实性、准确性完整性承  
担法律责任。中国农业银行股份有限公司承诺以勤勉尽责的原则履行受托职责,并由董事长签章。  
基金管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利。

本基金的财产由基金管理人管理,并根据基金合同和招募说明书的规定使用基金财产,投资者应当注意阅读。

本年度报告经审计,报告附注已经基金托管人复核,并由基金管理人复核。

报告编制期间(2014年6月29日至2015年6月29日)基金净值为1.6513元,基金份额总额342,318,687.00份。

基金名称:国寿安保中证500ETF

场内简称:国寿500

基金代码:510660

基金运作方式:契约型开放式(ETP)

基金合同生效日:2015年6月20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

报告期末基金份额总额:342,318,687.00份

基金合同存续期间:不定期

基金上市的证券交易所:上海证券交易所

上市日期:2015-07-03

基金产品说明:紧密跟踪标的指数,追求幅度和误差最小化。

本基金为股票型基金,风险与收益高于货币基金、债券型基金与货币市

场基金。本基金采用完全复制的指数投资策略,具有与标的指数、以及标的

指数所代表的股票市场相近的风险收益特征。

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

姓名 张彬 林巍

信息披露负责人 联系电话 010-50807044 010-6000009

电子邮箱 publis@gsfund.com.cn tgcxpl@cbircn.com

客户服务电话 4009-256-258 95569

传真 010-50807076 010-68121816

登载基金年度报告的网站: http://www.gsufund.com

基金持有人、基金管理人处

基金年度报告发布地点:北京市朝阳区

§ 3 主要财务指标:基金净值涨跌及利润分配情况

金额单位:人民币元

2.1 基金份额和价格指标:2015年5月29日(基金合同生效日)-2015年12月31日

本期实现收益 -77,812,223.46

本期利润 -150,940,634.35

加权平均基金份额本期利润 -0.018

本期基金份额净值增长率为 -27.71%

3.1.2 期末数据和指标:2015年末

期初可供基金份额净值 -0.0564

期末可供基金份额净值 534,464,068.10

期末基金份额净值 1.6513

注:本报告期在评价本期利润时考虑了现金股利、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扣除相关费用后的余额。

上一级基金的销售费用不包括有买入交易基金的费用,计价费用由投资人承担的交易费用水平要低于所列数字。

3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

3.2.1 累计份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的比较

阶段 份额净值增长率 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率差值 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 24.74% 2.03% 24.40% 2.06% 0.34% -0.02%

过去六个月 -12.62% 3.18% -14.47% 3.23% 1.85% -0.08%

自基合同生起 -27.71% 3.20% -22.81% 3.30% -4.90% -0.10%

3.2.2 日基金净值变化以相对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.3 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.4 日基金净值变化以相对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.5 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.6 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.7 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.8 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.9 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.10 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.11 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.12 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.13 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.14 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.15 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.16 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.17 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.18 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.19 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.20 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.21 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.22 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.23 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.24 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.25 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.26 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.27 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.28 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.29 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.30 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.31 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.32 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.33 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.34 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.35 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.36 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.37 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.38 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.39 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.40 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.41 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.42 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.43 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.44 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.45 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.46 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.47 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.48 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.49 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.50 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.51 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.52 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.53 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.54 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.55 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.56 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.57 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.58 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.59 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.60 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.61 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.62 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.63 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.64 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.65 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.66 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.67 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.68 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.69 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.70 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.71 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.72 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.73 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.74 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.75 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.76 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.77 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.78 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.79 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.80 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.81 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.82 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.83 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.84 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.85 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.86 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较

3.2.87 日基金净值变化以绝对基准收益计算的净值增长率与同期业绩比较基准的比较