

信息披露

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2016年4月22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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于2016年4月21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。
本报告期中财务资料未经审计。
本报告期自2016年1月1日起至3月31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	150900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	324,318,687.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪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，跟踪标的指数成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数的成份及权重进行动态调整。
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，预期风险与预期收益高于混合型基金、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相近的风险收益特征。
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

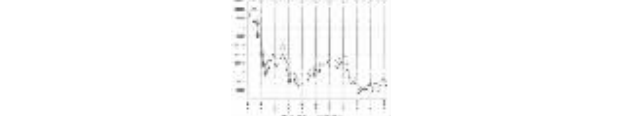
主要财务指标	报告期（2016年1月1日 - 2016年3月31日）
1.本期已实现收益	-15,294,794.18
2.本期利润	-102,039,676.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3033
4.期末基金资产净值	410,977,556.06
5.期末基金份额净值	1.2672

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水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-18.69%	-3.10%	-19.10%	3.26%	0.35%	-0.07%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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个月内使基金的资产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

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李康	基金经理	2015年5月29日	-	6年	李康先生，博士研究生，2009年10月至2012年12月就职于中国国际金融有限公司，任助理分析师；2012年12月至2013年11月就职于长城基金管理有限公司，任助理研究员；2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司，任基金基金经理助理，现任国寿安保沪深300指数证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。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，本着诚实信用、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，未发现异常交易行为。报告期内，未发现异常交易行为。
4.4 报告期内本基金投资策略和运作分析
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。
4.5 报告期内基金业绩表现
截至2016年3月31日，本基金资产净值为1,267.2元，累计份额净值为0.5688元。报告期内净值增长率为-18.69%，同期业绩基准收益为-19.10%。
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	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	408,568,672.05	99.28
2	其中：股票	408,568,672.05	99.28
3	固定收益投资	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	2,824,429.30	0.69
10	其他资产	123,560.03	0.03
11	合计	411,516,661.41	100.00

国寿安保基金管理有限公司
2016年4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：招商证券股份有限公司
报告送出日期：2016年4月22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。
基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于2016年4月21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。
本报告期中财务资料未经审计。
本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证养老产业指数分级
场内简称	国寿养老
交易代码	160801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月26日
报告期末基金份额总额	293,157,638.72份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证养老产业指数，在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重进行动态调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成份股停牌限投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理投资方法对基金投资组合进行适当调整，追求基金跟踪标的指数的表现。
业绩比较基准	65%中证养老产业指数收益率+35%银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，国寿养老A份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；国寿养老B份额具有高风险、预期收益相对较高的特征。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司
基金托管人：招商证券股份有限公司
报告送出日期：2016年4月22日

§ 3 主要财务指标

主要财务指标	报告期（2016年1月1日 - 2016年3月31日）
1.本期已实现收益	-4,879,534.69
2.本期利润	-23,694,827.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1291
4.期末基金资产净值	228,585,242.09
5.期末基金份额净值	0.8000

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水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-16.49%	2.90%	-17.46%	2.92%	0.97%	-0.02%

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）	占基金资产净值比例（%）
A	农林、牧、渔业	8,179,580.72	3.99%
B	采矿业	13,910,791.84	6.28%
C	制造业	246,792,730.69	60.65%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,496,092.20	2.90%
E	建筑业	11,693,692.22	2.94%
F	批发和零售业	26,027,735.46	6.33%
G	交通运输、仓储和邮政业	12,080,718.51	2.94%
H	住宿和餐饮业	927,726.07	0.23%
I	信息技术、软件和信息技术服务业	24,018,578.88	5.94%
J	金融业	4,074,390.50	0.90%
K	房地产业	27,081,339.74	6.59%
L	租赁和商业服务业	7,159,349.90	1.75%
M	科学研究和技术服务业	1,777,240.00	0.43%
N	水利、环境和公共设施管理业	3,379,955.60	0.82%
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,192,500.00	0.29%
R	文化、体育和娱乐业	5,518,070.76	1.34%
S	综合	3,288,177.44	0.79%
合计		408,568,672.05	99.41%

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组合

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	18,200	3,053,900.00	0.74
2	002018	华信国际	58,200	2,565,456.00	0.62
3	600564	中安消	75,500	2,177,420.00	0.53
4	600584	长电科技	97,000	2,135,940.00	0.52
5	600201	生物股份	66,400	2,054,416.00	0.50
6	600122	宏图高科	104,600	2,031,332.00	0.49
7	600079	人福医药	104,200	1,938,492.00	0.47
8	002085	万丰奥威	52,800	1,881,792.00	0.46
9	002405	四维图新	69,800	1,849,002.00	0.45
10	000748	长城信息	75,400	1,775,670.00	0.43

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内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。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	122,757.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	80,022.1
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	122,757.92

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002018	华信国际	2,565,456.00	0.62	公告重大事项
2	600564	中安消	2,177,420.00	0.53	公告重大事项
3	600584	长电科技	2,135,940.00	0.52	公告重大事项
4	600122	宏图高科	2,031,332.00	0.49	公告重大事项
5	002405	四维图新	1,849,002.00	0.45	公告重大事项

5.11.6 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

项目	单位：份
报告期初基金份额总额	342,318,687.00
报告期内基金总申购份额	2,000,000.00
减：报告期内基金总赎回份额	20,000,000.00
报告期内基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期末基金份额总额	324,318,687.00

国寿安保基金管理有限公司
2016年4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：招商证券股份有限公司
报告送出日期：2016年4月22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。
基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于2016年4月21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。
本报告期中财务资料未经审计。
本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证养老产业指数分级
场内简称	国寿养老
交易代码	160801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月26日
报告期末基金份额总额	293,157,638.72份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证养老产业指数，在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重进行动态调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成份股停牌限投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理投资方法对基金投资组合进行适当调整，追求基金跟踪标的指数的表现。
业绩比较基准	65%中证养老产业指数收益率+35%银行人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，国寿养老A份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；国寿养老B份额具有高风险、预期收益相对较高的特征。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司
基金托管人：招商证券股份有限公司
报告送出日期：2016年4月22日

§ 3 主要财务指标

主要财务指标	报告期（2016年1月1日 - 2016年3月31日）
1.本期已实现收益	-4,879,534.69
2.本期利润	-23,694,827.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1291
4.期末基金资产净值	228,585,242.09
5.期末基金份额净值	0.8000

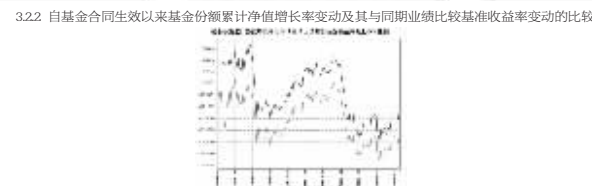
注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-16.49%	2.90%	-17.46%	2.92%	0.97%	-0.02%

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

【2016】第一季度报告



注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

注：本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。

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2016】第一季度报告

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2016年4月22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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于2016年4月21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。
本报告期中财务资料未经审计。
本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证500ETF联接
代码	001241
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月29日
报告期末基金份额总额	361,793,072.41份
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，紧密跟踪标的指数即中证500指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	