

## 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对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、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。

基金管理人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。

本报告中财务数据未经审计。

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 510660

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 324,318,697.00份

紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。

本基金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，具有与标的指

数一致的回报特征。本基金不进行现金差额调整。

投资策略 本基金通过构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的

变化进行定期调整。

业绩比较基准 中证500指数

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

数一致的回报特征。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期( 2016年1月1日 – 2016年3月31日 )

1.本期实现收益 -15,294,784.18

2.本期利润 -102,939,767.40

3.加权平均基金份额本期利润 -0.3033

4.期末基金份额净值 410,977,566.66

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据。

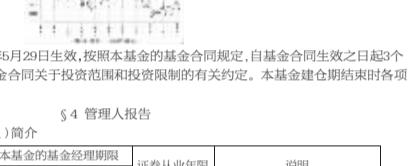
## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 本基金报告期内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① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -18.84% 3.18% -19.19% 3.25% 0.35% -0.07%

## 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个月内本基金的投资范围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 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10月就职于公司，任职助理研究员；2012年10月至2013年1月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013年1月加入国寿安保基金管理有限公司，担任国寿安保中证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托管人。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

报告期内，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 公平交易专章说明

## 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。本公司公告，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纪且对基金财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达成交易较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情形。

## 4.4 报告期内基金投资组合运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差自报告期长期停牌等导致引起的股价权重偏重、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对跟踪误差不利因素的影响，并且，逐日跟踪实际表现与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金未发生违法违纪且对基金财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达成交易较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情形。

## 4.6 报告期内基金净值增长率偏离度情况

本基金报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

## 4.7 报告期内前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未持有前十名股票中存在流通受限情况的股票。

## 4.8 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 122,757.82

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 802.21

5 应收申购款 -

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 123,566.03

5.1 其他资产构成

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(%)

1 002018 华信国际 2,565,464.00 0.62

2 000954 中安消 2,177,420.00 0.53

3 600694 长电科技 2,135,940.00 0.52

4 600122 宏图高科 2,031,322.00 0.49

5 四维图新 1,849,002.00 0.45

6 中国太保 1,630,200.00 0.40

7 中国平安 1,560,000.00 0.38

8 中国国航 1,516,661.41 0.38

9 中国交建 1,480,000.00 0.36

10 中国人寿 1,470,000.00 0.36

11 中国银行 1,460,000.00 0.36

12 中国石油 1,450,000.00 0.36

13 中国石化 1,440,000.00 0.36

14 中国铁建 1,430,000.00 0.36

15 中国中铁 1,420,000.00 0.36

16 中国建筑 1,410,000.00 0.36

17 中国交控 1,400,000.00 0.36

18 中国国旅 1,390,000.00 0.36

19 中国太保寿险 1,380,000.00 0.36

20 中国人寿寿险 1,370,000.00 0.36

21 中国人寿财险 1,360,000.00 0.36

22 中国人寿养老 1,350,000.00 0.36

23 中国人寿健康 1,340,000.00 0.36

24 中国人寿产险 1,330,000.00 0.36

25 中国人寿寿险 1,320,000.00 0.36

26 中国人寿寿险 1,310,000.00 0.36

27 中国人寿寿险 1,300,000.00 0.36

28 中国人寿寿险 1,290,000.00 0.36

29 中国人寿寿险 1,280,000.00 0.36

30 中国人寿寿险 1,270,000.00 0.36

31 中国人寿寿险 1,260,000.00 0.36

32 中国人寿寿险 1,250,000.00 0.36

33 中国人寿寿险 1,240,000.00 0.36

34 中国人寿寿险 1,230,000.00 0.36

35 中国人寿寿险 1,220,000.00 0.36

36 中国人寿寿险 1,210,000.00 0.36

37 中国人寿寿险 1,200,000.00 0.36

38 中国人寿寿险 1,190,000.00 0.36

39 中国人寿寿险 1,180,000.00 0.36

40 中国人寿寿险 1,170,000.00 0.36

41 中国人寿寿险 1,160,000.00 0.36

42 中国人寿寿险 1,150,000.00 0.36

43 中国人寿寿险 1,140,000.00 0.36

44 中国人寿寿险 1,130,000.00 0.36

45 中国人寿寿险 1,120,000.00 0.36

46 中国人寿寿险 1,110,000.00 0.36

47 中国人寿寿险 1,100,000.00 0.36

48 中国人寿寿险 1,090,000.00 0.36

49 中国人寿寿险 1,080,000.00 0.36

50 中国人寿寿险 1,070,000.00 0.36

51 中国人寿寿险 1,060,000.00 0.36

52 中国人寿寿险 1,050,000.00 0.36

53 中国人寿寿险 1,040,000.00 0.36

54 中国人寿寿险 1,030,000.00 0.36

55 中国人寿寿险 1,020,000.00 0.36

56 中国人寿寿险 1,010,000.00 0.36

57 中国人寿寿险 1,000,000.00 0.36

58 中国人寿寿险 990,000.00 0.36

59 中国人寿寿险 980,000.00 0.36

60 中国人寿寿险 970,000.00 0.36

61 中国人寿寿险 960,000.00 0.36

62 中国人寿寿险 950,000.00 0.36

63 中国人寿寿险 940,000.00 0.36

64 中国人寿寿险 930,000.00 0.36

65 中国人寿寿险 920,000.00 0.36

66 中国人寿寿险 910,000.00 0.36

67 中国人寿寿险 900,000.00 0.36

68 中国人寿寿险 890,000.0