

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2017年第四季度报告

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。本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离、日常申赎和 market 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不利因素的影响。并且,逐日跟踪实际组合与标的指数的表现,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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3234 元;本报告期基金份额净值增长率为 -4.84%,业绩比较基准收益率为 -5.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

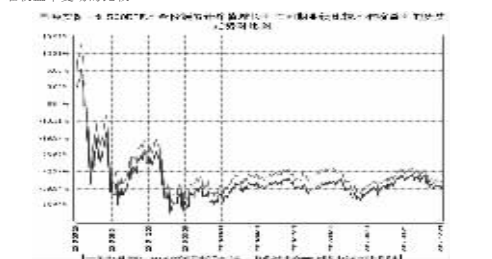
无。

§ 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	224,035,044.53	97.96
2	基金投资	224,035,044.53	97.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	4,646,523.51	2.03
11	其他资产	9,606.97	0.00
12	合计	228,691,175.01	100.00

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	3,775,575.10	1.66
B	采矿业	8,030,279.76	3.52
C	制造业	133,426,359.07	58.51
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	7,052,373.40	3.09
E	建筑业	5,073,148.91	2.22
F	批发和零售业	11,850,523.60	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	7,216,763.17	3.16
H	住宿和餐饮业	277,694.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,387,204.00	8.08
J	金融业	4,156,258.00	1.82
K	房地产业	13,328,124.95	5.84
L	租赁和商务服务业	3,753,479.07	1.65
M	科学研究和技术服务业	479,960.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	2,473,169.50	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	267,866.00	0.12
Q	卫生和社会工作	412,677.60	0.18
R	文化、体育和娱乐业	9,265,767.90	4.08
S	综合	1,139,620.00	0.50
合计		224,035,044.53	98.24

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李刚	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	7 年	李刚先生,博士研究生,2009 年 10 月 5 日至 2012 年 12 月就职于中国国寿资产管理,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,2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于民生证券资产管理,任民生证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任本基金基金经理。曾任国寿安保沪深 300 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

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。本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离、日常申赎和 market 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不利因素的影响。并且,逐日跟踪实际组合与标的指数的表现,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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3234 元;本报告期基金份额净值增长率为 -4.84%,业绩比较基准收益率为 -5.34%。

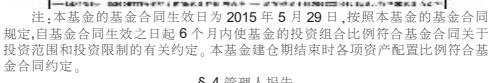
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	224,035,044.53	97.96
2	基金投资	224,035,044.53	97.96
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	4,646,523.51	2.03
11	其他资产	9,606.97	0.00
12	合计	228,691,175.01	100.00

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	3,775,575.10	1.66
B	采矿业	8,030,279.76	3.52
C	制造业	133,426,359.07	58.51
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	7,052,373.40	3.09
E	建筑业	5,073,148.91	2.22
F	批发和零售业	11,850,523.60	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	7,216,763.17	3.16
H	住宿和餐饮业	277,694.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,387,204.00	8.08
J	金融业	4,156,258.00	1.82
K	房地产业	13,328,124.95	5.84
L	租赁和商务服务业	3,753,479.07	1.65
M	科学研究和技术服务业	479,960.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	2,473,169.50	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	267,866.00	0.12
Q	卫生和社会工作	412,677.60	0.18
R	文化、体育和娱乐业	9,265,767.90	4.08
S	综合	1,139,620.00	0.50
合计		224,035,044.53	98.24



注:本基金的基金合同生效日为 2015 年 5 月 29 日,按照本基金的基金合同规定,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。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李刚	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	7 年	李刚先生,博士研究生,2009 年 10 月 5 日至 2012 年 12 月就职于中国国寿资产管理,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,2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于民生证券资产管理,任民生证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任本基金基金经理。曾任国寿安保沪深 300 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

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。本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离、日常申赎和 market 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不利因素的影响。并且,逐日跟踪实际组合与标的指数的表现,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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3234 元;本报告期基金份额净值增长率为 -4.84%,业绩比较基准收益率为 -5.34%。

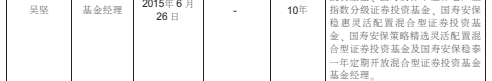
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	90,499,301.87	94.54
2	基金投资	90,499,301.87	94.54
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	5,178,089.65	5.41
11	其他资产	48,764.34	0.05
12	合计	95,726,155.86	100.00

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,255,992.58	40.17
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,255,147.14	9.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,693,113.28	13.28
J	金融业	14,765,879.75	15.50
K	房地产业	6,383,264.28	6.70
L	租赁和商务服务业	2,234,452.82	2.35
M	科学研究和技术服务业	1,185,600.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	1,077,380.00	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,143,428.00	1.20
Q	卫生和社会工作	2,361,267.60	2.48
R	文化、体育和娱乐业	12,613,194.59	13.24
S	综合	-	-
合计		90,499,301.87	95.03



注:本基金的基金合同于 2015 年 6 月 26 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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴晨	基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	10 年	吴晨先生,博士研究生,曾任中国建设银行总行金融市场部,中国光大资产管理,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,2015 年 6 月 26 日加入国寿安保基金管理有限公司任本基金基金经理。曾任国寿安保中证 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

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。本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离、日常申赎和 market 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不利因素的影响。并且,逐日跟踪实际组合与标的指数的表现,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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3234 元;本报告期基金份额净值增长率为 -4.84%,业绩比较基准收益率为 -5.34%。

4.6 报告期内基金持有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	90,499,301.87	94.54
2	基金投资	90,499,301.87	94.54
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	金融衍生品投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	5,178,089.65	5.41
11	其他资产	48,764.34	0.05
12	合计	95,726,155.86	100.00

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	38,255,992.58	40.17
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,255,147.14	9.72
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,693,113.28	13.28
J	金融业	14,765,879.75	15.50
K	房地产业	6,383,264.28	6.70
L	租赁和商务服务业	2,234,452.82	2.35
M	科学研究和技术服务业	1,185,600.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	1,077,380.00	1.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,143,428.00	1.20
Q	卫生和社会工作	2,361,267.60	2.48
R	文化、体育和娱乐业	12,613,194.59	13.24
S	综合	-	-
合计		90,499,301.87	95.03

注:本基金的基金合同于 2015 年 6 月 26 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。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约。

§ 4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴晨	基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	10 年	吴晨先生,博士研究生,曾任中国建设银行总行金融市场部,中国光大资产管理,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,2015 年 6 月 26 日加入国寿安保基金管理有限公司任本基金基金经理。曾任国寿安保中证 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

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。