

2017年 12月 31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
报告送出日期：2018年 1月 20日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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，并对其实质性、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合同规定，于2018年1月10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。

本公司对财务数据进行审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 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	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 5月 29日
报告期末基金份额总额	172,318,687.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差和跟踪偏离度最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，不能主动买入股票，按照行业分类指数成份股的权重比例进行投资，根据标的指数的成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为指数型基金，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指数组合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 2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日
1.本期已实现收益	-1,519,436.30
2.本期利润	-11,708,202
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0876
4.期末基金资产净值	228,040,844.54
5.期末基金份额净值	1.3234

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真实收益水平可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金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①	净值增长标准差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	-0.48%	0.96%	-5.34%	0.08%	0.50%	-0.02%

注：本基金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真实收益水平可能低于所列数字。

3.2.2 报告期内基金净值增长率变化图

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反向交易成交较少的单边交

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。

本基金跟踪误差的主要来源是股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离，日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。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，逐日跟踪实际组合与标的指数的表现的偏差，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

5.1 报告期末基金资产组合情况

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
	其中：股票	224,035,044.53	97.96

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的规定。

§ 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	证券从业年限	说明
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	7 年	李康先生，博士研究生，曾任中国银行总行金融市场部交易员，2012 年 10 月至 2013 年 12 月就职于中国银河金融控股有限公司，2013 年 1 月加入国寿安保基金管理有限公司，任量化研究员，2013 年 11 月就职于国寿安保基金管理有限公司，任基金经理。2014 年 1 月加入国寿安保基金管理有限公司，任基金经理。2015 年 5 月加入国寿安保基金管理有限公司，任基金经理。2016 年 1 月加入国寿安保基金管理有限公司，任基金经理。2017 年 5 月加入国寿安保基金管理有限公司，任基金经理。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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的规定。

5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

5.3.1 报告期末按品种分类的债券投资组合

5.3.2 报告期末按品种分类的金融工具投资组合

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的规定。

5.4 报告期末按公允价值品种分类的债券投资组合

5.4.1 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明细

5.4.2 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

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的规定。

5.5 报告期末按公允价值品种分类的应收款项

5.5.1 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应收款项

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的规定。

5.6 报告期末按公允价值品种分类的其他应收款

5.6.1 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其他应收款

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的规定。

5.7 报告期末按公允价值品种分类的存货

5.7.1 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存货

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的规定。

5.8 报告期末按公允价值品种分类的其他资产

5.8.1 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其他资产

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的规定。

5.9 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基金投资情况

5.9.1 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

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的规定。

5.9.2 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债券投资组合

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的规定。

5.9.3 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贵金属投资组合

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的规定。

5.9.4 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金融工具投资组合

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的规定。

5.9.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名其他投资组合

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的规定。

5.10 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组合

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的规定。

5.11 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贵金属支持证券投资组合

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的规定。

5.12 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金融工具支持证券投资组合

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的规定。

5.13 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其他支持证券投资组合

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的规定。

5.14 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组合

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的规定。

5.1