

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

2017年年度报告摘要

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
送出日期:2018年3月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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，并对内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人中农银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、资产负债表、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基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告全文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至2017年1月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证500ETF联接
基金代码	001241
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5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
报告期末基金总资产	399,196,478.34元
基金合同的延续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金
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	2016年5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
报告期末基金总资产	399,196,478.34元
基金合同的延续期	不定期

2.2 基金产品说明

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，紧密跟踪该指数的收益率和波动率，追求超越标的指数的收益。
投资策略	本基金主要投资于目标ETF，方便持有人的申购(通过买入并持有目标ETF)和赎回(通过卖出并赎回目标ETF)的投资管理。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行定期存款(税后)×5%
风险收益特征	本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金，其风险收益特征与标的指数所表示的风险收益特征一致。本基金通过投资于标的指数成份股、备选成份股以及现金类资产，力争达到与标的指数相似的表现。

上述定价与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中国国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其约定分别提供在银行间同业市场交易和在交易所市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金份额净值预警情形的说明

无。

5.6 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守规定情况说明

在托管本报告期内，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定以及基本合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人一视同仁，没有损害本基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本基金托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策、财务状况报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

5.6 审计报告

本报告已经安永华明会计师事务所审阅并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告的全部内容，可登录载于国寿安保基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

	2017年	2016年	2015年1月1日至2015年12月31日
本期实现收益	-976,396.11	-6,529,620.00	-153,033,812.97
本期利润	3,916,466.66	-39,068,065.33	-129,064,296.72
加权平均基金份额本期利润	0.0003	-0.0072	-0.3397
本期基金份额净值增长率	1.56%	-15.75%	-30.97%
3.12月末数和指标	2017年末	2016年末	
期末可供分配基金份额	-0.0119	-0.0174	-0.0399
期末基金财产净值	231,194,600.12	281,364,367.69	253,618,349.28
期末基金份额净值	0.9517	1.0000	0.9913

注：本期已实现收益指本基金本期利息收入、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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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



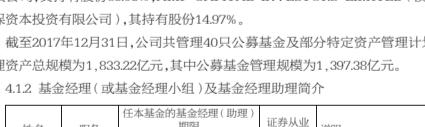
注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



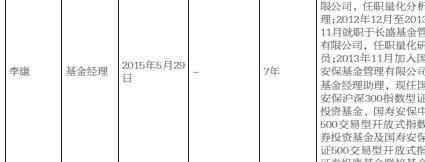
注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



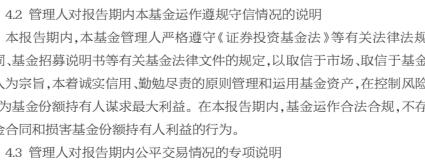
注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.4 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



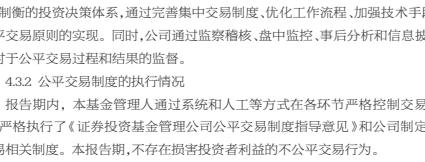
注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.5 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.6 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.7 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.8 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.9 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.10 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.11 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.12 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.13 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：本基金的基金合同生效日为2015年5月20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相关约定。本基金在基金存续期间将根据资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.14 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

