

国寿安保中证 500 交易型开放式
指数证券投资基金
2016 年年度报告

2016 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

送出日期：2017 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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，并对其内容的真实性、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 2017 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
§6 审计报告	12
6.1 审计报告基本信息.....	12
6.2 审计报告的基本内容.....	12
§7 年度财务报表	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 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.....	56

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
8.8 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贵金属投资明细	56
8.9 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	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12 投资组合报告附注	56
§9 基金份额持有人信息	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末上市基金前十名持有人	57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	58
§10 开放式基金份额变动	58
§11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	60
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 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
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500
基金主代码	510560
基金运作方式	契约型开放式 (ETF)
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 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
报告期末基金份额总额	204,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95599
传真	010-50850776	010-68121816
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王军辉	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 5 月 29 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-126,481,756.24	-77,812,233.46
本期利润	-94,764,809.74	-159,940,634.35
加权平均基金份额本期利润	-0.3473	-0.4618
本期加权平均净值利润率	-27.35%	-31.86%
本期基金份额净值增长率	-16.79%	-27.71%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-175,819,876.25	-204,834,675.21
期末可供分配基金份额利润	-0.8605	-0.5984
期末基金资产净值	265,443,058.59	534,464,068.10
期末基金份额净值	1.2992	1.5613
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-39.84%	-27.71%

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

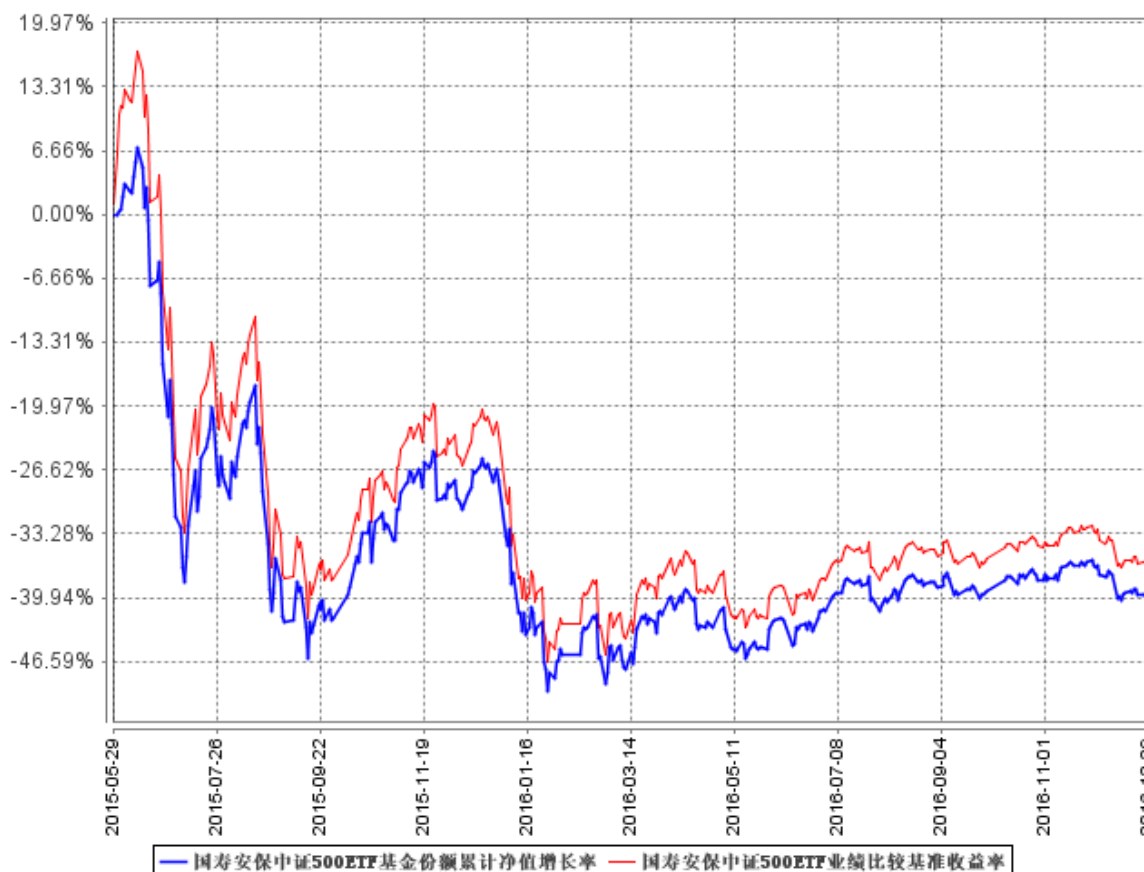
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.04%	0.81%	-1.02%	0.83%	-0.02%	-0.02%

过去六个月	2.32%	0.91%	2.29%	0.92%	0.03%	-0.01%
过去一年	-16.79%	1.87%	-17.78%	1.90%	0.99%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-39.84%	2.45%	-36.53%	2.51%	-3.31%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

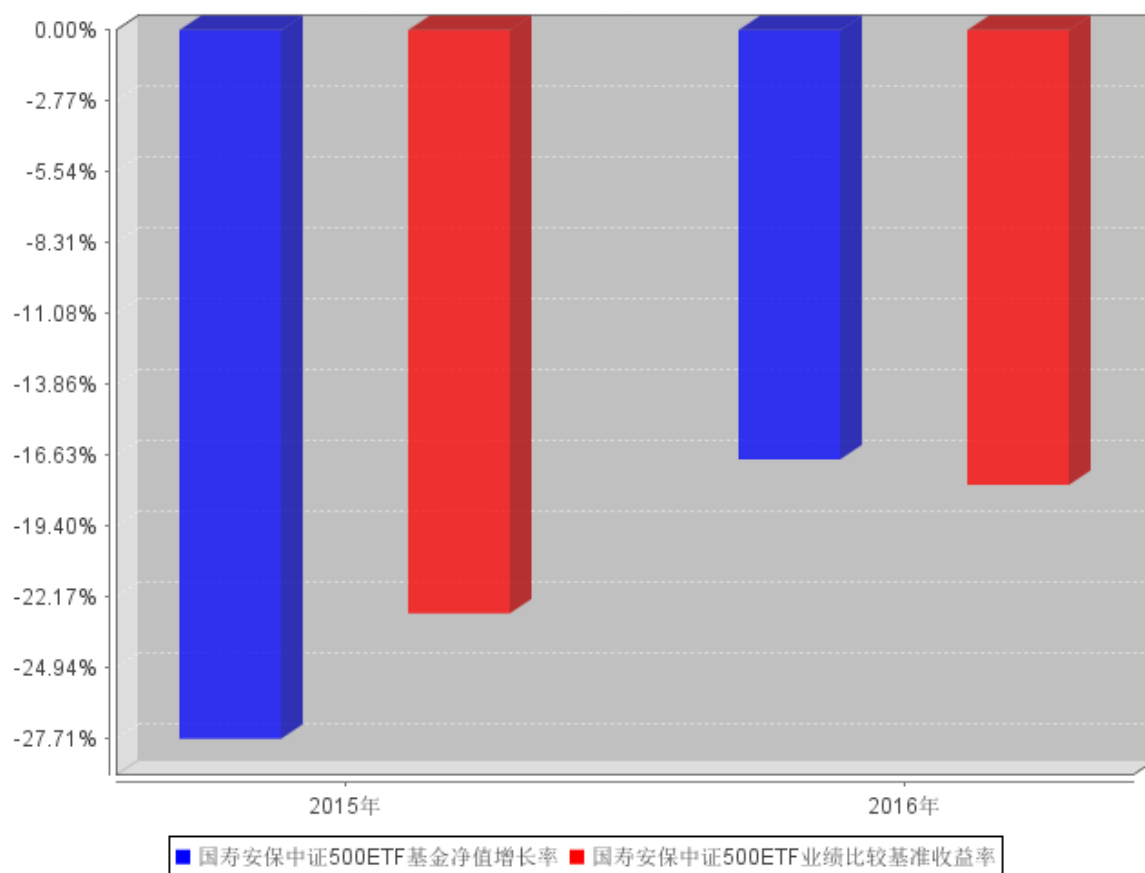
国寿安保中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

国寿安保中证500ETF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对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准,于2013年10月29日设立,公司注册资本5.88亿元人民币,公司股东为中国人寿资产管理有限公司,持有股份85.03%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(澳大利亚安保资本投资有限公司),持有股份14.97%。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 25 只开放式基金及若干专户，公司管理资产总规模为 1151.37 亿元，其中公募基金管理规模 785.16 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
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，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、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，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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，

保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理人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。

4.3.3 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易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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，逐日跟踪实际组合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。

4.4.2 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 1.2992 元，累计份额净值为 0.6016 元。报告期内净值增长率为-16.79%，同期业绩基准涨幅为-17.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观经济处于稳中逐步弱复苏的过程，货币政策当前也并未有显著收紧迹象。严控杠杆收购、收紧再融资等监管措施净化了市场环境，将促使市场回归价值投资的良性轨道。经济政策层面，需要关注新兴产业的支持力度，传统产业供给侧改革、国企改革、PPP 和一带一路等。在社会经济转型加速叠加产业政策支持的大背景下，市场结构性机会将不断凸显。整体来看，A 股市场仍将延续结构性投资行情，呈现震荡偏强态势。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。上述参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央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，由其按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固定收益品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，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》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《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、收益分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)字第 61090605_A09 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，和 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国寿安保基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	辜虹	吴军
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,218,971.22	9,519,577.44
结算备付金		-	175,187.36
存出保证金		99,907.12	483,860.55

交易性金融资产	7.4.7.2	263,627,678.04	524,946,562.09
其中：股票投资		263,627,678.04	524,946,562.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	6,592.82
应收利息	7.4.7.5	507.56	2,463.72
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		265,947,063.94	535,134,243.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		8,894.40	12,707.54
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		114,935.19	226,324.57
应付托管费		22,987.03	45,264.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	57,188.73	145,878.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	300,000.00	240,000.00
负债合计		504,005.35	670,175.88
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	441,262,934.84	739,298,743.31
未分配利润	7.4.7.10	-175,819,876.25	-204,834,675.21
所有者权益合计		265,443,058.59	534,464,068.10
负债和所有者权益总计		265,947,063.94	535,134,243.98

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.2992 元，基金份额总额 204,318,687.00 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-91,367,428.24	-156,319,686.49
1.利息收入		37,907.56	266,029.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	37,888.62	246,643.41
债券利息收入		18.94	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	19,385.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-123,909,173.94	-75,482,806.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-126,431,352.18	-77,056,815.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	10,579.46	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,511,598.78	1,574,009.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	31,716,946.50	-82,128,400.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	786,891.64	1,025,491.77
减：二、费用		3,397,381.50	3,620,947.86
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,737,443.30	1,473,445.02
2.托管费	7.4.10.2.2	347,488.66	294,689.00
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.交易费用	7.4.7.19	796,222.37	1,416,953.52
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.20	516,227.17	435,860.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-94,764,809.74	-159,940,634.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-94,764,809.74	-159,940,634.35

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	739,298,743.31	-204,834,675.21	534,464,068.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-94,764,809.74	-94,764,809.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-298,035,808.47	123,779,608.70	-174,256,199.77
其中：1.基金申购款	237,564,774.66	-94,379,969.11	143,184,805.55
2.基金赎回款	-535,600,583.13	218,159,577.81	-317,441,005.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	441,262,934.84	-175,819,876.25	265,443,058.59
项目	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	665,869,631.00	-	665,869,631.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-159,940,634.35	-159,940,634.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	73,429,112.31	-44,894,040.86	28,535,071.45
其中：1.基金申购款	298,035,808.41	-106,002,928.33	192,032,880.08
2.基金赎回款	-224,606,696.10	61,108,887.47	-163,497,808.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	739,298,743.31	-204,834,675.21	534,464,068.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 左季庆	_____ 左季庆	_____ 韩占锋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2015]485 号文《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 22 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2015)验字第 61090605_A04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 5 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 665,869,631.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国寿安保，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。为了更好的跟踪标的指数，基金管理人在本基金基金份额上市前可进行基金份额折算并提前公告。在本基金基金份额上市后，基金

管理人也可以根据运作情况决定是否对基金份额进行折算并提前公告，无需召开份额持有人大会。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金的报告期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。唯上年度报告期间为 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或

资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负

债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收

基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括红利再投资、基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成

本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提；

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提；

(3) 标的指数许可使用费按本基金资产净值的 0.03%的年费率逐日计提。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

(3) 在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

- (7) 本基金收益分配采取现金分红；
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营

业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	2,218,971.22	9,519,577.44
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	2,218,971.22	9,519,577.44

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	314,039,132.43	263,627,678.04	-50,411,454.39

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	314,039,132.43	263,627,678.04	-50,411,454.39
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	607,074,962.98	524,946,562.09	-82,128,400.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	607,074,962.98	524,946,562.09	-82,128,400.89

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	458.06	2,137.57
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	0.00	86.68
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	49.50	239.47
合计	507.56	2,463.72

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	57,188.73	145,878.85
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	57,188.73	145,878.85

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	250,000.00	190,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	300,000.00	240,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	342,318,687.00	739,298,743.31
本期申购	110,000,000.00	237,564,774.66
本期赎回(以“-”号填列)	-248,000,000.00	-535,600,583.13
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	204,318,687.00	441,262,934.84

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-86,523,683.11	-118,310,992.10	-204,834,675.21
本期利润	-126,481,756.24	31,716,946.50	-94,764,809.74
本期基金份额交易产生的变动数	67,598,308.26	56,181,300.44	123,779,608.70

其中：基金申购款	-62,949,517.43	-31,430,451.68	-94,379,969.11
基金赎回款	130,547,825.69	87,611,752.12	218,159,577.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-145,407,131.09	-30,412,745.16	-175,819,876.25

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	32,834.38	230,637.71
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,382.67	13,608.77
其他	1,671.57	2,396.93
合计	37,888.62	246,643.41

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-76,237,569.41	-50,794,340.57
股票投资收益——赎回差价收入	-50,193,782.77	-26,262,475.14
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-126,431,352.18	-77,056,815.71

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	311,559,843.94	279,161,494.86
减：卖出股票成本总额	387,797,413.35	329,955,835.43
买卖股票差价收入	-76,237,569.41	-50,794,340.57

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
----	-----------------------------	--

		日
赎回基金份额对价总额	317,441,005.32	163,497,808.63
减：现金支付赎回款总额	168,441,261.32	86,535,872.63
减：赎回股票成本总额	199,193,526.77	103,224,411.14
赎回差价收入	-50,193,782.77	-26,262,475.14

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	10,579.46	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	10,579.46	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	74,598.40	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	64,000.00	-
减：应收利息总额	18.94	-
买卖债券差价收入	10,579.46	-

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券产生的收益/损失。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资产生的收益/损失。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,511,598.78	1,574,009.06
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,511,598.78	1,574,009.06

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	31,716,946.50	-82,128,400.89
——股票投资	31,716,946.50	-82,128,400.89
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	31,716,946.50	-82,128,400.89

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	786,891.64	1,000,681.42
其他	-	24,810.35
合计	786,891.64	1,025,491.77

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	796,222.37	1,416,953.52
银行间市场交易费用	-	-
合计	796,222.37	1,416,953.52

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	180,000.00	180,000.00
银行费用	6,227.17	8,291.35
指数使用费	200,000.00	117,168.97
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	-	400.00
合计	516,227.17	435,860.32

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.1.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	国寿资产的最终控制人
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,737,443.30	1,473,445.02
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:基金管理费每日计提,按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	347,488.66	294,689.00

注:基金托管费每日计提,按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
-------	-------------------------	--------------------------

	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
集团公司	-	-	115,773,298.00	33.82%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年5月29日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,218,971.22	32,834.38	9,519,577.44	230,637.71

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成 本总额	期末估 值总额	备注
000547	航天发展	2016年6月13日	公告重大事项	15.36	2017年1月3日	16.90	82,800	2,184,966.56	1,271,808.00	-
000887	中鼎股份	2016年11月18日	公告重大事项	25.94	2017年2月15日	23.99	42,300	1,206,223.05	1,097,262.00	-
601168	西部矿业	2016年12月19日	公告重大事项	7.83	-	-	127,066	922,102.30	994,926.78	-
002602	世纪华通	2016年12月15日	公告重大事项	46.89	2017年1月9日	50.00	20,600	558,550.56	965,934.00	-
000748	长城信息	2016年11月1日	公告重大事项 直至终止上市	20.31	-	-	45,400	1,325,529.69	922,074.00	
002400	省广股份	2016年11月28日	公告重大事项	13.79	-	-	65,430	1,273,986.12	902,279.70	-
300088	长信科技	2016年9月12日	公告重大事项	15.80	-	-	55,800	810,719.73	881,640.00	-
600673	东阳光科	2016年11月15日	公告重大事项	7.29	-	-	119,300	983,017.29	869,697.00	-
600655	豫园商城	2016年12月20日	公告重大事项	11.42	-	-	67,030	1,147,176.81	765,482.60	-

002491	通鼎互联	2016 年 12 月 22 日	公告重大事项	15.54	2017 年 1 月 3 日	15.89	47,700	784,650.16	741,258.00	-
000697	炼石有色	2016 年 11 月 17 日	公告重大事项	23.51	-	-	31,200	718,131.53	733,512.00	-
000050	深天马 A	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	38,900	802,982.37	732,098.00	-
600161	天坛生物	2016 年 12 月 6 日	公告重大事项	39.40	-	-	17,700	634,763.15	697,380.00	-
600687	刚泰控股	2016 年 7 月 25 日	公告重大事项	16.42	2017 年 1 月 18 日	16.38	40,500	672,986.59	665,010.00	-
600151	航天机电	2016 年 11 月 11 日	公告重大事项	10.97	-	-	59,300	789,047.57	650,521.00	-
000563	陕国投 A	2016 年 10 月 14 日	公告重大事项	7.48	2017 年 1 月 18 日	6.73	86,100	540,883.00	644,028.00	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	公告重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	189,300	645,290.11	637,941.00	-
600645	中源协和	2016 年 12 月 13 日	公告重大事项	26.80	-	-	20,600	958,274.96	552,080.00	-
002440	闰土股份	2016 年 10 月 24 日	公告重大事项	16.34	2017 年 1 月 12 日	15.22	32,000	653,649.36	522,880.00	-
600171	上海贝岭	2016 年 12 月 14 日	公告重大事项	14.05	2017 年 2 月 16 日	14.90	35,900	720,198.72	504,395.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	公告重大事项	11.28	-	-	40,400	653,529.53	455,712.00	-
002396	星网锐捷	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	19.70	2017 年 2 月 21 日	18.35	22,800	582,245.53	449,160.00	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	公告重大事项	25.20	-	-	17,720	467,974.73	446,544.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	公告重大事项	12.50	-	-	33,300	809,235.39	416,250.00	-
600859	王府井	2016 年 9 月 27 日	公告重大事项	16.28	-	-	25,360	518,237.30	412,860.80	-
600537	亿晶光电	2016 年 12 月 27 日	公告重大事项	7.43	2017 年 1 月 13 日	8.17	54,994	482,114.88	408,605.42	-
002635	安洁科技	2016 年 11 月 8 日	公告重大事项	36.40	2017 年 2 月 8 日	33.50	10,789	320,886.54	392,719.60	-
002727	一心堂	2016 年 12 月 28 日	公告重大事项	21.20	2017 年 1 月 5 日	21.66	17,300	457,138.96	366,760.00	-
002681	奋达科技	2016 年 12 月 19 日	公告重大事项	12.93	-	-	24,960	446,027.62	322,732.80	-
600551	时代出版	2016 年 11 月 28 日	公告重大事项	20.32	-	-	14,000	308,404.84	284,480.00	-
603169	兰石重装	2016 年 11 月 24 日	公告重大事项	13.36	2017 年 3 月 21 日	14.32	21,200	377,147.68	283,232.00	-
603555	贵人鸟	2016 年 12 月 12 日	公告重大事项	30.76	-	-	8,200	294,086.81	252,232.00	-
601005	重庆钢铁	2016 年 6 月 2 日	公告重大事项	2.52	-	-	92,700	438,049.62	233,604.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 18 日	公告重大事项	36.49	-	-	6,300	217,147.52	229,887.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价

格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末未持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,218,971.22	-	-	-	2,218,971.22
存出保证金	99,907.12	-	-	-	99,907.12
交易性金融资产	-	-	-	263,627,678.04	263,627,678.04
应收利息	-	-	-	507.56	507.56
资产总计	2,318,878.34	-	-	263,628,185.60	265,947,063.94
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	114,935.19	114,935.19
应付托管费	-	-	-	22,987.03	22,987.03
应付交易费用	-	-	-	57,188.73	57,188.73
其他负债	-	-	-	308,894.40	308,894.40
负债总计	-	-	-	504,005.35	504,005.35
利率敏感度缺口	2,318,878.34	-	-	263,124,180.25	265,443,058.59
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,519,577.44	-	-	-	9,519,577.44
结算备付金	175,187.36	-	-	-	175,187.36
存出保证金	483,860.55	-	-	-	483,860.55
交易性金融资产	-	-	-	524,946,562.09	524,946,562.09
应收证券清算款	-	-	-	6,592.82	6,592.82
应收利息	-	-	-	2,463.72	2,463.72
资产总计	10,178,625.35	-	-	524,955,618.63	535,134,243.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	226,324.57	226,324.57
应付托管费	-	-	-	45,264.92	45,264.92
应付交易费用	-	-	-	145,878.85	145,878.85
其他负债	-	-	-	252,707.54	252,707.54
负债总计	-	-	-	670,175.88	670,175.88

利率敏感度缺口	10,178,625.35	-	-	524,285,442.75	534,464,068.10
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款等，除此之外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	263,627,678.04	99.32	524,946,562.09	98.22
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	263,627,678.04	99.32	524,946,562.09	98.22

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；

	Beta 系数是 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	+5%	13,034,855.21	25,614,842.16
-5%	-13,034,855.21	-25,614,842.16	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 242,920,691.34 元（上年度末：471,551,265.33 元），属于第二层次的余额为人民币 20,706,986.70 元（上年度末：53,395,612.76 元），本报告期末及上年度末均无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产均未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	263,627,678.04	99.13
	其中：股票	263,627,678.04	99.13
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,218,971.22	0.83
7	其他各项资产	100,414.68	0.04
8	合计	265,947,063.94	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,372,860.50	1.27
B	采矿业	10,535,787.72	3.97
C	制造业	163,479,771.66	61.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,159,252.70	3.07
E	建筑业	7,518,078.46	2.83
F	批发和零售业	15,696,951.54	5.91
G	交通运输、仓储和邮政业	7,361,049.99	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,824,019.45	5.96
J	金融业	2,046,321.50	0.77
K	房地产业	16,568,181.60	6.24
L	租赁和商务服务业	3,984,575.20	1.50
M	科学研究和技术服务业	778,318.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	1,184,759.20	0.45

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	133,221.00	0.05
Q	卫生和社会工作	706,560.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	3,910,509.62	1.47
S	综合	2,367,459.90	0.89
	合计	263,627,678.04	99.32

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	249,600	1,307,904.00	0.49
2	600201	生物股份	40,900	1,292,031.00	0.49
3	600522	中天科技	121,900	1,283,607.00	0.48
4	300136	信维通信	44,900	1,279,650.00	0.48
5	000547	航天发展	82,800	1,271,808.00	0.48
6	600682	南京新百	33,200	1,237,364.00	0.47
7	600584	长电科技	69,100	1,219,615.00	0.46
8	600079	人福医药	60,020	1,197,399.00	0.45
9	600219	南山铝业	370,150	1,143,763.50	0.43
10	002405	四维图新	56,900	1,101,015.00	0.41
11	000887	中鼎股份	42,300	1,097,262.00	0.41
12	600487	亨通光电	57,900	1,080,414.00	0.41
13	600158	中体产业	45,100	1,063,007.00	0.40
14	002092	中泰化学	85,902	1,039,414.20	0.39
15	600525	长园集团	72,580	1,012,491.00	0.38
16	300156	神雾环保	40,400	1,010,404.00	0.38
17	000661	长春高新	9,030	1,010,005.50	0.38
18	002572	索菲亚	18,489	1,001,364.24	0.38
19	601168	西部矿业	127,066	994,926.78	0.37
20	600643	爱建集团	79,150	982,251.50	0.37
21	600315	上海家化	35,900	973,249.00	0.37
22	002602	世纪华通	20,600	965,934.00	0.36
23	600166	福田汽车	311,400	962,226.00	0.36
24	002460	赣锋锂业	35,200	933,152.00	0.35

25	300115	长盈精密	35,780	932,426.80	0.35
26	600143	金发科技	119,500	929,710.00	0.35
27	002422	科伦药业	57,600	928,512.00	0.35
28	002366	台海核电	17,300	927,626.00	0.35
29	300266	兴源环境	16,900	927,472.00	0.35
30	600436	片仔癀	20,150	922,668.50	0.35
31	000748	长城信息	45,400	922,074.00	0.35
32	600521	华海药业	41,790	920,633.70	0.35
33	601012	隆基股份	68,400	915,876.00	0.35
34	002407	多氟多	33,500	914,215.00	0.34
35	300296	利亚德	27,100	913,812.00	0.34
36	002400	省广股份	65,430	902,279.70	0.34
37	002508	老板电器	24,400	897,920.00	0.34
38	000998	隆平高科	41,890	897,702.70	0.34
39	002340	格林美	135,922	890,289.10	0.34
40	600503	华丽家族	106,800	885,372.00	0.33
41	300088	长信科技	55,800	881,640.00	0.33
42	000581	威孚高科	39,000	875,160.00	0.33
43	002168	深圳惠程	55,100	873,886.00	0.33
44	600664	哈药股份	101,726	872,809.08	0.33
45	300026	红日药业	160,700	872,601.00	0.33
46	600673	东阳光科	119,300	869,697.00	0.33
47	600879	航天电子	57,000	868,680.00	0.33
48	000930	中粮生化	64,400	865,536.00	0.33
49	002004	华邦健康	95,050	862,103.50	0.32
50	000997	新大陆	43,819	851,403.17	0.32
51	002439	启明星辰	40,600	844,074.00	0.32
52	600978	宜华生活	79,100	842,415.00	0.32
53	600266	北京城建	62,700	835,791.00	0.31
54	002176	江特电机	68,600	818,398.00	0.31
55	002701	奥瑞金	94,280	814,579.20	0.31
56	600138	中青旅	38,600	809,442.00	0.30
57	600500	中化国际	69,400	809,204.00	0.30
58	600497	驰宏锌锗	115,000	808,450.00	0.30
59	000690	宝新能源	87,000	806,490.00	0.30
60	000961	中南建设	76,750	798,200.00	0.30
61	600699	均胜电子	23,800	787,542.00	0.30
62	002030	达安基因	33,880	786,016.00	0.30
63	002013	中航机电	42,789	782,610.81	0.29

64	600635	大众公用	129,300	777,093.00	0.29
65	002311	海大集团	51,340	772,667.00	0.29
66	600426	华鲁恒升	58,150	770,487.50	0.29
67	002271	东方雨虹	35,400	767,826.00	0.29
68	600655	豫园商城	67,030	765,482.60	0.29
69	000970	中科三环	56,800	758,280.00	0.29
70	600122	宏图高科	61,400	750,308.00	0.28
71	002573	清新环境	42,700	745,969.00	0.28
72	300253	卫宁健康	37,900	742,461.00	0.28
73	600759	洲际油气	75,490	741,311.80	0.28
74	002491	通鼎互联	47,700	741,258.00	0.28
75	300324	旋极信息	38,300	740,339.00	0.28
76	000697	炼石有色	31,200	733,512.00	0.28
77	000050	深天马 A	38,900	732,098.00	0.28
78	002038	双鹭药业	27,400	731,854.00	0.28
79	000400	许继电气	40,300	731,445.00	0.28
80	300113	顺网科技	27,200	731,408.00	0.28
81	600418	江淮汽车	63,200	730,592.00	0.28
82	600614	鼎立股份	62,400	730,080.00	0.28
83	002179	中航光电	20,060	727,977.40	0.27
84	600751	天海投资	85,900	718,124.00	0.27
85	600565	迪马股份	96,700	717,514.00	0.27
86	600240	华业资本	66,400	713,136.00	0.27
87	002001	新 和 成	36,300	711,480.00	0.27
88	600312	平高电气	45,300	707,586.00	0.27
89	300244	迪安诊断	22,080	706,560.00	0.27
90	600388	龙净环保	57,000	705,090.00	0.27
91	002273	水晶光电	35,400	704,460.00	0.27
92	600594	益佰制药	42,300	704,295.00	0.27
93	000959	首钢股份	105,900	701,058.00	0.26
94	600633	浙报传媒	39,600	699,336.00	0.26
95	600161	天坛生物	17,700	697,380.00	0.26
96	000806	银河生物	44,000	696,960.00	0.26
97	000012	南 玻 A	61,279	694,903.86	0.26
98	002223	鱼跃医疗	22,300	691,746.00	0.26
99	002665	首航节能	78,810	690,375.60	0.26
100	000598	兴蓉环境	119,500	688,320.00	0.26
101	600811	东方集团	95,300	681,395.00	0.26
102	000566	海南海药	53,500	679,985.00	0.26

103	002217	合力泰	37,900	678,410.00	0.26
104	000975	银泰资源	43,331	677,696.84	0.26
105	600056	中国医药	35,600	677,468.00	0.26
106	600094	大名城	75,900	675,510.00	0.25
107	300159	新研股份	49,700	674,926.00	0.25
108	000939	凯迪生态	52,400	674,388.00	0.25
109	600601	方正科技	146,393	673,407.80	0.25
110	002221	东华能源	54,100	670,299.00	0.25
111	600528	中铁二局	48,600	668,736.00	0.25
112	000878	云南铜业	56,600	668,446.00	0.25
113	000078	海王生物	106,000	667,800.00	0.25
114	600787	中储股份	73,400	665,738.00	0.25
115	600687	刚泰控股	40,500	665,010.00	0.25
116	600881	亚泰集团	121,400	664,058.00	0.25
117	300055	万邦达	40,400	661,752.00	0.25
118	002410	广联达	44,800	654,080.00	0.25
119	600198	大唐电信	41,200	653,844.00	0.25
120	000988	华工科技	41,600	651,040.00	0.25
121	002408	齐翔腾达	59,181	650,991.00	0.25
122	600200	江苏吴中	33,700	650,747.00	0.25
123	600151	航天机电	59,300	650,521.00	0.25
124	600478	科力远	65,004	650,040.00	0.24
125	002353	杰瑞股份	32,000	649,600.00	0.24
126	600435	北方导航	49,700	648,088.00	0.24
127	300134	大富科技	25,536	647,592.96	0.24
128	000031	中粮地产	72,600	647,592.00	0.24
129	002048	宁波华翔	29,200	646,488.00	0.24
130	000999	华润三九	26,100	645,453.00	0.24
131	000960	锡业股份	49,100	644,192.00	0.24
132	000563	陕国投 A	86,100	644,028.00	0.24
133	601699	潞安环能	79,800	642,390.00	0.24
134	000612	焦作万方	55,600	642,180.00	0.24
135	600410	华胜天成	58,920	640,460.40	0.24
136	002191	劲嘉股份	61,400	639,174.00	0.24
137	600176	中国巨石	64,940	639,009.60	0.24
138	000727	华东科技	189,300	637,941.00	0.24
139	600755	厦门国贸	77,700	637,140.00	0.24
140	600516	方大炭素	68,800	637,088.00	0.24
141	600851	海欣股份	49,200	636,156.00	0.24

142	600549	厦门钨业	28,800	634,176.00	0.24
143	000979	中弘股份	239,800	633,072.00	0.24
144	002250	联化科技	39,000	631,020.00	0.24
145	000667	美好集团	170,700	629,883.00	0.24
146	000758	中色股份	78,800	629,612.00	0.24
147	600026	中远海能	91,259	621,473.79	0.23
148	002018	华信国际	60,800	618,336.00	0.23
149	000488	晨鸣纸业	59,400	615,384.00	0.23
150	000786	北新建材	59,600	613,284.00	0.23
151	600098	广州发展	54,600	612,612.00	0.23
152	600572	康恩贝	83,754	612,241.74	0.23
153	601929	吉视传媒	145,300	608,807.00	0.23
154	600064	南京高科	36,000	603,000.00	0.23
155	600575	皖江物流	104,300	599,725.00	0.23
156	000825	太钢不锈	152,000	598,880.00	0.23
157	600325	华发股份	46,761	598,540.80	0.23
158	603019	中科曙光	21,500	598,130.00	0.23
159	600863	内蒙华电	193,700	596,596.00	0.22
160	600967	北方创业	43,897	595,682.29	0.22
161	600160	巨化股份	56,300	595,654.00	0.22
162	000006	深振业 A	63,000	595,350.00	0.22
163	600108	亚盛集团	103,900	594,308.00	0.22
164	000860	顺鑫农业	26,600	585,200.00	0.22
165	600120	浙江东方	20,200	584,184.00	0.22
166	603766	隆鑫通用	28,100	583,918.00	0.22
167	002657	中科金财	13,500	582,660.00	0.22
168	002544	杰赛科技	20,600	579,684.00	0.22
169	600409	三友化工	61,700	579,363.00	0.22
170	601880	大连港	206,440	578,032.00	0.22
171	600511	国药股份	19,100	574,910.00	0.22
172	600039	四川路桥	120,862	572,885.88	0.22
173	600307	酒钢宏兴	208,800	570,024.00	0.21
174	600499	科达洁能	75,320	569,419.20	0.21
175	002051	中工国际	24,824	568,966.08	0.21
176	300287	飞利信	47,800	568,820.00	0.21
177	002375	亚厦股份	53,700	568,146.00	0.21
178	002672	东江环保	32,150	565,840.00	0.21
179	002276	万马股份	37,600	565,128.00	0.21
179	002078	太阳纸业	84,600	565,128.00	0.21

180	600316	洪都航空	28,700	564,242.00	0.21
181	600808	马钢股份	198,936	562,988.88	0.21
182	600717	天津港	55,800	562,464.00	0.21
183	002390	信邦制药	56,800	561,752.00	0.21
184	600022	山东钢铁	224,700	561,750.00	0.21
185	002019	亿帆医药	36,700	561,143.00	0.21
186	002595	豪迈科技	26,600	559,930.00	0.21
187	002444	巨星科技	35,800	558,480.00	0.21
188	300273	和佳股份	32,718	558,169.08	0.21
189	600416	湘电股份	37,800	556,038.00	0.21
190	000513	丽珠集团	9,297	553,171.50	0.21
191	002384	东山精密	28,200	553,002.00	0.21
192	600645	中源协和	20,600	552,080.00	0.21
193	002155	湖南黄金	48,104	550,790.80	0.21
194	600466	蓝光发展	56,900	550,223.00	0.21
195	300199	翰宇药业	30,601	550,205.98	0.21
196	000066	长城电脑	44,200	549,848.00	0.21
197	002281	光迅科技	7,000	549,500.00	0.21
198	002489	浙江永强	72,550	549,203.50	0.21
199	000028	国药一致	8,200	548,580.00	0.21
200	600611	大众交通	83,400	547,938.00	0.21
201	000685	中山公用	49,200	547,596.00	0.21
202	000089	深圳机场	68,400	547,200.00	0.21
203	002022	科华生物	27,300	546,000.00	0.21
204	000543	皖能电力	71,670	545,408.70	0.21
205	600600	青岛啤酒	18,500	544,640.00	0.21
206	002268	卫士通	17,300	543,566.00	0.20
207	002640	跨境通	29,500	539,850.00	0.20
208	600348	阳泉煤业	80,200	539,746.00	0.20
209	600770	综艺股份	52,000	538,200.00	0.20
210	600062	华润双鹤	24,200	537,966.00	0.20
211	000401	冀东水泥	45,000	535,500.00	0.20
212	600597	光明乳业	41,000	535,460.00	0.20
213	002266	浙富控股	92,380	532,108.80	0.20
214	002261	拓维信息	44,500	530,440.00	0.20
215	002050	三花股份	48,000	529,920.00	0.20
216	300122	智飞生物	32,000	527,040.00	0.20
217	600183	生益科技	47,900	526,900.00	0.20
218	600884	杉杉股份	37,400	526,592.00	0.20

219	600380	健康元	52,900	525,297.00	0.20
220	002477	雏鹰农牧	104,600	525,092.00	0.20
221	600872	中炬高新	37,200	523,776.00	0.20
222	002440	闰土股份	32,000	522,880.00	0.20
223	600187	国中水务	97,000	522,830.00	0.20
224	000592	平潭发展	77,300	522,548.00	0.20
225	600300	维维股份	78,000	521,040.00	0.20
226	002603	以岭药业	30,100	518,924.00	0.20
227	600392	盛和资源	38,850	517,870.50	0.20
228	000519	江南红箭	34,462	513,483.80	0.19
229	600366	宁波韵升	26,000	511,940.00	0.19
230	002373	千方科技	36,800	507,840.00	0.19
231	600267	海正药业	38,600	507,590.00	0.19
232	002431	棕榈股份	55,100	504,716.00	0.19
233	600171	上海贝岭	35,900	504,395.00	0.19
234	002122	天马股份	39,600	502,524.00	0.19
235	600073	上海梅林	43,775	501,223.75	0.19
236	002308	威创股份	33,900	499,686.00	0.19
237	600017	日照港	123,100	498,555.00	0.19
238	600067	冠城大通	69,600	498,336.00	0.19
239	002073	软控股份	43,900	498,265.00	0.19
240	600970	中材国际	70,200	497,718.00	0.19
241	600422	昆药集团	36,800	497,168.00	0.19
242	300274	阳光电源	46,920	494,536.80	0.19
243	600125	铁龙物流	61,000	492,880.00	0.19
244	600587	新华医疗	19,600	492,156.00	0.19
245	600086	东方金钰	45,100	490,688.00	0.18
246	600298	安琪酵母	27,450	489,159.00	0.18
247	600175	美都能源	98,689	488,510.55	0.18
248	600216	浙江医药	38,500	488,180.00	0.18
249	000703	恒逸石化	32,462	487,903.86	0.18
250	600651	飞乐音响	46,300	487,539.00	0.18
251	600557	康缘药业	28,760	486,906.80	0.18
252	600284	浦东建设	36,900	486,711.00	0.18
253	000810	创维数字	34,500	485,415.00	0.18
254	002437	誉衡药业	58,657	485,093.39	0.18
255	000926	福星股份	38,000	484,120.00	0.18
256	300291	华录百纳	21,722	483,966.16	0.18
257	300010	立思辰	29,000	481,980.00	0.18

258	600260	凯乐科技	31,133	481,938.84	0.18
259	000816	智慧农业	75,700	481,452.00	0.18
260	000418	小天鹅 A	14,800	478,336.00	0.18
261	002512	达华智能	29,200	476,836.00	0.18
262	000937	冀中能源	70,700	476,518.00	0.18
263	600536	中国软件	19,800	476,388.00	0.18
264	002358	森源电气	24,800	475,664.00	0.18
265	002002	鸿达兴业	64,508	473,488.72	0.18
266	002479	富春环保	31,900	472,758.00	0.18
267	000762	西藏矿业	27,750	472,582.50	0.18
268	600694	大商股份	11,800	471,174.00	0.18
269	601231	环旭电子	43,600	466,956.00	0.18
270	601801	皖新传媒	26,500	465,605.00	0.18
271	002028	思源电气	35,220	464,199.60	0.17
272	601311	骆驼股份	28,300	462,139.00	0.17
273	000021	深科技	49,000	462,070.00	0.17
274	300001	特锐德	26,600	461,244.00	0.17
275	000777	中核科技	20,500	458,790.00	0.17
276	600169	太原重工	113,200	456,196.00	0.17
277	000829	天音控股	40,400	455,712.00	0.17
278	002399	海普瑞	25,000	455,500.00	0.17
279	300166	东方国信	21,812	453,471.48	0.17
280	601010	文峰股份	86,200	453,412.00	0.17
281	601717	郑煤机	64,400	452,732.00	0.17
282	300202	聚龙股份	18,270	449,442.00	0.17
283	002396	星网锐捷	22,800	449,160.00	0.17
284	002325	洪涛股份	56,070	449,120.70	0.17
285	601000	唐山港	111,520	447,195.20	0.17
286	600880	博瑞传播	51,000	446,760.00	0.17
287	603589	口子窖	13,900	446,607.00	0.17
288	002025	航天电器	17,720	446,544.00	0.17
289	600765	中航重机	31,100	445,663.00	0.17
290	002503	搜于特	30,930	445,082.70	0.17
291	002041	登海种业	23,550	444,624.00	0.17
292	600517	置信电气	45,300	440,769.00	0.17
293	000848	承德露露	39,190	438,536.10	0.17
294	600545	新疆城建	36,000	437,760.00	0.16
295	002707	众信旅游	28,100	436,955.00	0.16
296	002244	滨江集团	62,300	434,854.00	0.16

297	600058	五矿发展	28,545	434,740.35	0.16
298	600809	山西汾酒	17,300	432,846.00	0.16
299	600736	苏州高新	47,800	431,634.00	0.16
300	001696	宗申动力	45,800	430,520.00	0.16
301	002123	梦网荣信	28,700	430,500.00	0.16
302	600259	广晟有色	10,100	429,149.00	0.16
303	000620	新华联	50,600	429,088.00	0.16
304	002581	未名医药	17,600	427,152.00	0.16
305	002368	太极股份	13,900	425,479.00	0.16
306	002589	瑞康医药	13,100	425,095.00	0.16
307	002063	远光软件	32,350	425,079.00	0.16
308	000158	常山股份	34,000	425,000.00	0.16
309	000600	建投能源	47,800	424,464.00	0.16
310	002106	莱宝高科	37,600	422,624.00	0.16
311	002269	美邦服饰	84,300	422,343.00	0.16
312	002344	海宁皮城	37,300	422,236.00	0.16
313	000587	金洲慈航	28,300	421,104.00	0.16
314	600291	西水股份	21,900	420,042.00	0.16
315	600835	上海机电	21,500	419,680.00	0.16
316	000693	ST 华泽	33,300	416,250.00	0.16
317	002285	世联行	54,559	414,648.40	0.16
318	600220	江苏阳光	95,200	413,168.00	0.16
319	600859	王府井	25,360	412,860.80	0.16
320	603188	亚邦股份	23,100	412,566.00	0.16
321	000062	深圳华强	14,500	411,945.00	0.16
322	000572	海马汽车	76,700	411,112.00	0.15
323	600282	南钢股份	132,100	409,510.00	0.15
324	600537	亿晶光电	54,994	408,605.42	0.15
325	600433	冠豪高新	50,900	408,218.00	0.15
326	000636	风华高科	41,800	407,968.00	0.15
327	600481	双良节能	54,100	406,832.00	0.15
328	002277	友阿股份	28,300	406,388.00	0.15
329	601678	滨化股份	55,560	405,032.40	0.15
330	002317	众生药业	32,600	402,610.00	0.15
331	600993	马应龙	20,090	401,197.30	0.15
332	002354	天神娱乐	5,800	401,128.00	0.15
333	600053	九鼎投资	8,700	400,722.00	0.15
334	601777	力帆股份	41,900	400,564.00	0.15
335	600270	外运发展	24,200	400,268.00	0.15

336	002161	远望谷	34,600	398,938.00	0.15
337	300147	香雪制药	30,900	398,610.00	0.15
338	000616	海航投资	76,300	398,286.00	0.15
339	600277	亿利洁能	55,700	396,027.00	0.15
340	002482	广田集团	42,800	395,900.00	0.15
341	300257	开山股份	22,900	392,964.00	0.15
342	002635	安洁科技	10,789	392,719.60	0.15
343	600894	广日股份	28,700	392,329.00	0.15
344	600580	卧龙电气	43,000	391,300.00	0.15
345	300297	蓝盾股份	31,400	390,616.00	0.15
346	000669	金鸿能源	22,700	389,305.00	0.15
347	002505	大康农业	109,770	388,585.80	0.15
348	000973	佛塑科技	51,594	386,955.00	0.15
349	002428	云南锗业	30,500	386,435.00	0.15
350	000090	天健集团	39,980	386,206.80	0.15
351	000541	佛山照明	39,200	385,728.00	0.15
352	600805	悦达投资	45,428	385,683.72	0.15
353	600826	兰生股份	14,100	385,212.00	0.15
354	000501	鄂武商A	19,700	384,544.00	0.14
355	000726	鲁泰A	30,000	384,300.00	0.14
356	000528	柳工	52,538	384,052.78	0.14
357	601689	拓普集团	13,000	382,460.00	0.14
358	000830	鲁西化工	68,400	382,356.00	0.14
359	600289	亿阳信通	29,500	382,025.00	0.14
360	002498	汉缆股份	88,710	381,453.00	0.14
361	002056	横店东磁	27,400	381,134.00	0.14
362	002690	美亚光电	18,000	380,880.00	0.14
363	000652	泰达股份	68,900	380,328.00	0.14
364	600729	重庆百货	16,200	379,566.00	0.14
365	600458	时代新材	26,700	377,805.00	0.14
366	600823	世茂股份	53,600	376,272.00	0.14
367	002128	露天煤业	43,640	375,304.00	0.14
368	002005	德豪润达	65,200	374,900.00	0.14
369	600112	天成控股	34,000	373,320.00	0.14
370	002463	沪电股份	78,100	373,318.00	0.14
371	600596	新安股份	36,240	371,097.60	0.14
372	002242	九阳股份	20,526	370,083.78	0.14
373	600750	江中药业	12,000	369,840.00	0.14
374	000897	津滨发展	86,200	368,936.00	0.14

375	002064	华峰氨纶	67,100	368,379.00	0.14
376	002190	成飞集成	11,500	367,770.00	0.14
377	600006	东风汽车	53,400	367,392.00	0.14
378	002727	一心堂	17,300	366,760.00	0.14
379	000680	山推股份	66,200	366,086.00	0.14
380	600141	兴发集团	24,000	365,040.00	0.14
381	600628	新世界	25,800	364,554.00	0.14
382	000861	海印股份	75,110	364,283.50	0.14
383	600351	亚宝药业	36,738	362,971.44	0.14
384	000969	安泰科技	34,300	361,522.00	0.14
385	600395	盘江股份	44,200	356,694.00	0.13
386	000681	视觉中国	18,691	356,250.46	0.13
387	601233	桐昆股份	24,709	354,821.24	0.13
388	002588	史丹利	31,100	352,985.00	0.13
389	002254	泰和新材	28,540	352,754.40	0.13
390	600790	轻纺城	48,850	351,720.00	0.13
391	000596	古井贡酒	7,700	350,350.00	0.13
392	603077	和邦生物	68,400	350,208.00	0.13
393	600428	中远海特	57,200	350,064.00	0.13
394	300032	金龙机电	21,700	349,153.00	0.13
395	002011	盾安环境	36,672	349,117.44	0.13
396	000552	靖远煤电	91,500	346,785.00	0.13
397	002663	普邦园林	57,000	345,990.00	0.13
398	600496	精工钢构	80,600	344,968.00	0.13
399	000049	德赛电池	8,200	344,810.00	0.13
400	600869	智慧能源	44,400	343,656.00	0.13
401	601001	大同煤业	55,900	341,549.00	0.13
402	002699	美盛文化	10,100	341,380.00	0.13
403	002642	荣之联	16,950	340,695.00	0.13
404	002345	潮宏基	28,200	340,656.00	0.13
405	600862	中航高科	27,800	340,272.00	0.13
406	300039	上海凯宝	33,200	339,636.00	0.13
407	600850	华东电脑	14,010	338,761.80	0.13
408	600720	祁连山	41,407	338,295.19	0.13
409	300043	星辉娱乐	33,201	336,658.14	0.13
410	600757	长江传媒	40,500	336,555.00	0.13
411	600059	古越龙山	32,400	331,776.00	0.12
412	000099	中信海直	28,300	331,393.00	0.12
413	600329	中新药业	19,000	331,360.00	0.12

414	600563	法拉电子	9,000	330,030.00	0.12
415	600280	中央商场	38,300	329,763.00	0.12
416	603369	今世缘	25,100	329,312.00	0.12
417	601886	江河集团	30,800	328,020.00	0.12
418	000869	张裕A	9,100	327,600.00	0.12
419	002371	七星电子	12,215	324,919.00	0.12
420	600639	浦东金桥	17,500	324,800.00	0.12
421	002681	奋达科技	24,960	322,732.80	0.12
422	600292	远达环保	25,960	321,125.20	0.12
423	600460	士兰微	51,600	320,952.00	0.12
424	002093	国脉科技	28,800	318,816.00	0.12
425	600831	广电网络	24,200	316,052.00	0.12
426	002332	仙琚制药	24,500	315,315.00	0.12
427	600586	金晶科技	68,100	315,303.00	0.12
428	000417	合肥百货	36,373	313,898.99	0.12
429	002342	巨力索具	44,900	310,259.00	0.12
430	600657	信达地产	50,800	309,880.00	0.12
431	002029	七匹狼	30,200	308,342.00	0.12
432	600195	中牧股份	14,400	306,000.00	0.12
433	002416	爱施德	20,700	304,911.00	0.11
434	000931	中关村	35,929	304,318.63	0.11
435	002309	中利科技	21,400	304,094.00	0.11
436	600825	新华传媒	34,900	303,281.00	0.11
437	000426	兴业矿业	34,700	302,584.00	0.11
438	600748	上实发展	36,920	302,374.80	0.11
439	601002	晋亿实业	31,700	301,784.00	0.11
440	002551	尚荣医疗	14,897	296,599.27	0.11
441	000877	天山股份	41,100	289,755.00	0.11
442	603198	迎驾贡酒	13,300	286,615.00	0.11
443	600640	号百控股	14,300	285,714.00	0.11
444	601908	京运通	40,000	284,800.00	0.11
445	002414	高德红外	12,500	284,750.00	0.11
446	600551	时代出版	14,000	284,480.00	0.11
447	603169	兰石重装	21,200	283,232.00	0.11
448	002251	步步高	17,210	283,104.50	0.11
449	002698	博实股份	18,170	282,906.90	0.11
450	600743	华远地产	62,560	278,392.00	0.10
451	600180	瑞茂通	20,300	274,862.00	0.10
452	000919	金陵药业	20,200	273,306.00	0.10

453	600776	东方通信	31,900	273,064.00	0.10
454	603528	多伦科技	4,100	267,935.00	0.10
455	600425	青松建化	55,200	256,680.00	0.10
456	600251	冠农股份	31,400	254,654.00	0.10
457	603555	贵人鸟	8,200	252,232.00	0.10
458	600338	西藏珠峰	8,700	252,126.00	0.09
459	600801	华新水泥	32,500	251,875.00	0.09
460	600335	国机汽车	20,600	250,290.00	0.09
461	002327	富安娜	28,400	249,920.00	0.09
462	002118	紫鑫药业	34,198	246,225.60	0.09
463	603806	福斯特	5,300	245,231.00	0.09
464	601016	节能风电	27,700	245,145.00	0.09
465	603001	奥康国际	10,700	245,030.00	0.09
466	600864	哈投股份	21,100	240,962.00	0.09
467	600397	安源煤业	46,200	238,392.00	0.09
468	000631	顺发恒业	48,644	238,355.60	0.09
469	600874	创业环保	29,000	235,770.00	0.09
470	002315	焦点科技	3,900	235,131.00	0.09
471	601005	重庆钢铁	92,700	233,604.00	0.09
472	002646	青青稞酒	12,000	231,000.00	0.09
473	002392	北京利尔	40,000	230,400.00	0.09
474	002745	木林森	6,300	229,887.00	0.09
475	600483	福能股份	20,700	229,149.00	0.09
476	603883	老百姓	4,900	228,585.00	0.09
477	603698	航天工程	8,200	226,238.00	0.09
478	603355	莱克电气	4,900	226,233.00	0.09
479	002233	塔牌集团	23,920	223,652.00	0.08
480	000517	荣安地产	42,500	223,550.00	0.08
481	603567	珍宝岛	11,300	223,288.00	0.08
482	600618	氯碱化工	15,100	220,309.00	0.08
483	600184	光电股份	10,200	220,116.00	0.08
484	603866	桃李面包	4,900	215,110.00	0.08
485	603328	依顿电子	6,600	211,068.00	0.08
486	600971	恒源煤电	33,400	209,418.00	0.08
487	000723	美锦能源	13,700	207,144.00	0.08
488	002249	大洋电机	23,700	204,531.00	0.08
489	600773	西藏城投	16,600	198,038.00	0.07
490	002194	武汉凡谷	15,100	194,186.00	0.07
491	000025	特力A	3,500	193,445.00	0.07

492	600088	中视传媒	8,800	192,896.00	0.07
493	600468	百利电气	14,500	188,790.00	0.07
494	603005	晶方科技	6,128	184,085.12	0.07
495	002238	天威视讯	12,344	180,839.60	0.07
496	600917	重庆燃气	11,400	150,366.00	0.06
497	603868	飞科电器	3,100	145,266.00	0.05
498	600981	汇鸿集团	16,400	139,236.00	0.05
499	603377	东方时尚	3,300	133,221.00	0.05
500	603025	大豪科技	3,200	124,896.00	0.05
501	603568	伟明环保	5,050	117,665.00	0.04
502	000761	本钢板材	20,100	108,138.00	0.04
503	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.03
504	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300113	顺网科技	2,747,403.69	0.51
2	002572	索菲亚	2,496,482.92	0.47
3	002426	胜利精密	2,326,058.00	0.44
4	002131	利欧股份	2,091,570.28	0.39
5	002038	双鹭药业	2,047,308.00	0.38
6	000983	西山煤电	2,006,987.49	0.38
7	002310	东方园林	1,889,218.00	0.35
8	002074	国轩高科	1,745,496.00	0.33
9	002368	太极股份	1,693,514.00	0.32
10	002366	台海核电	1,685,013.00	0.32
11	000581	威孚高科	1,610,393.00	0.30
12	000008	神州高铁	1,606,574.00	0.30
13	002699	美盛文化	1,563,325.64	0.29
14	002410	广联达	1,540,518.48	0.29
15	002268	卫士通	1,532,204.00	0.29
16	600166	福田汽车	1,527,740.50	0.29
17	002353	杰瑞股份	1,521,646.00	0.28
18	000598	兴蓉环境	1,513,021.00	0.28

19	000727	华东科技	1,502,695.00	0.28
20	002466	天齐锂业	1,476,467.00	0.28

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	4,332,463.22	0.81
2	300072	三聚环保	3,827,727.70	0.72
3	002085	万丰奥威	2,888,926.00	0.54
4	002310	东方园林	2,431,185.00	0.45
5	002405	四维图新	2,364,423.00	0.44
6	000983	西山煤电	2,344,489.49	0.44
7	002426	胜利精密	2,304,324.95	0.43
8	002049	紫光国芯	2,217,470.79	0.41
9	002131	利欧股份	2,123,500.90	0.40
10	002299	圣农发展	1,970,669.00	0.37
11	002340	格林美	1,930,938.67	0.36
12	002714	牧原股份	1,875,729.00	0.35
13	600654	中安消	1,848,301.00	0.35
14	300182	捷成股份	1,718,779.29	0.32
15	000671	阳光城	1,715,764.70	0.32
16	000661	长春高新	1,710,707.25	0.32
17	600816	安信信托	1,699,568.00	0.32
18	000887	中鼎股份	1,665,899.50	0.31
19	002074	国轩高科	1,643,607.00	0.31
20	600074	保千里	1,595,729.00	0.30

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	229,636,238.87
卖出股票收入（成交）总额	311,559,843.94

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除生物股份外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。

2016 年 12 月 1 日，生物股份收到中国证监会内蒙古监管局《关于对金宇生物技术股份有限公司采取责令改正措施的决定》（[2016]7 号），公司因财务报告列表、信息披露及内幕信息知情人登记执行不到位等问题被采取责令改正的行政监管措施。公司针对上述问题于 2016 年 12 月 21 日发布了相关问题整改报告。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	99,907.12

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	507.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	100,414.68

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000547	航天发展	1,271,808.00	0.48	公告重大事项

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
475	430,144.60	201,235,386.00	98.49%	3,083,301.00	1.51%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	新华人寿保险股份有限公司	17,686,229.00	8.66%
2	张红艳	243,300.00	0.12%
3	姜晓平	235,683.00	0.12%
4	李敏慧	231,516.00	0.11%
5	王梅	231,516.00	0.11%
6	孙建兴	183,563.00	0.09%
7	陈妙琴	139,373.00	0.07%

8	陈红兰	130,575.00	0.06%
9	朱庆芳	115,758.00	0.06%
10	包宏伟	92,607.00	0.05%
	国寿安保中证 500ETF 联接基金	183,486,286.00	89.80%

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	342,318,687.00
本报告期基金总申购份额	110,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	248,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	204,318,687.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2016 年 12 月 30 日发布公告，王军辉先生自 2016 年 12 月 28 日起任国寿安保基金管理有限公司董事长，相关任职资格已经中国证监会核准，刘慧敏先生因工作调动不再担任。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	283,960,532.48	52.64%	264,454.14	60.54%	-
中银国际	2	145,115,881.33	26.90%	91,612.33	20.97%	-
兴业证券	2	110,394,700.72	20.46%	80,732.02	18.48%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际	74,598.40	100.00%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月6日
2	国寿安保基金管理有限公司关于指数熔断后旗下部分基金临时调整交易时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月7日
3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月8日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书(摘要)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月13日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月20日
6	国寿安保基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年3月12日
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2015 年年度报告(摘要)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年3月28日
8	国寿安保中证 500 交易型开放式指	《中国证券报》、《上海证券	2016年4月22日

	数证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	报》、《证券时报》及公司网站	
9	国寿安保基金管理有限公司系统升级公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 8 日
10	国寿安保中证 500ETF 更新招募说明书（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 13 日
11	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 20 日
12	国寿安保基金关于参加诺亚正行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 21 日
13	国寿安保中证 500ETF2016 年半年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 8 月 26 日
14	国寿安保基金管理有限公司 2016 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 10 月 24 日
15	国寿安保基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《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》

12.1.3 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.gsfunds.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司
2017 年 3 月 28 日