

国寿安保中证 500 交易型
开放式指数证券投资基金
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 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 8 月 25 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。本半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 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
7.6 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.....	59
7.7 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.....	59
7.8 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.....	59
7.9 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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59

7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
8.4 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.....	61
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
10.2 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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§ 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	186,318,687.00 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	林葛
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-13,277,367.80
本期利润	-1,256,278.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0065
本期加权平均净值利润率	-0.50%
本期基金份额净值增长率	-0.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-162,310,691.12
期末可供分配基金份额利润	-0.8711
期末基金资产净值	240,078,007.85
期末基金份额净值	1.2885
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-40.34%

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

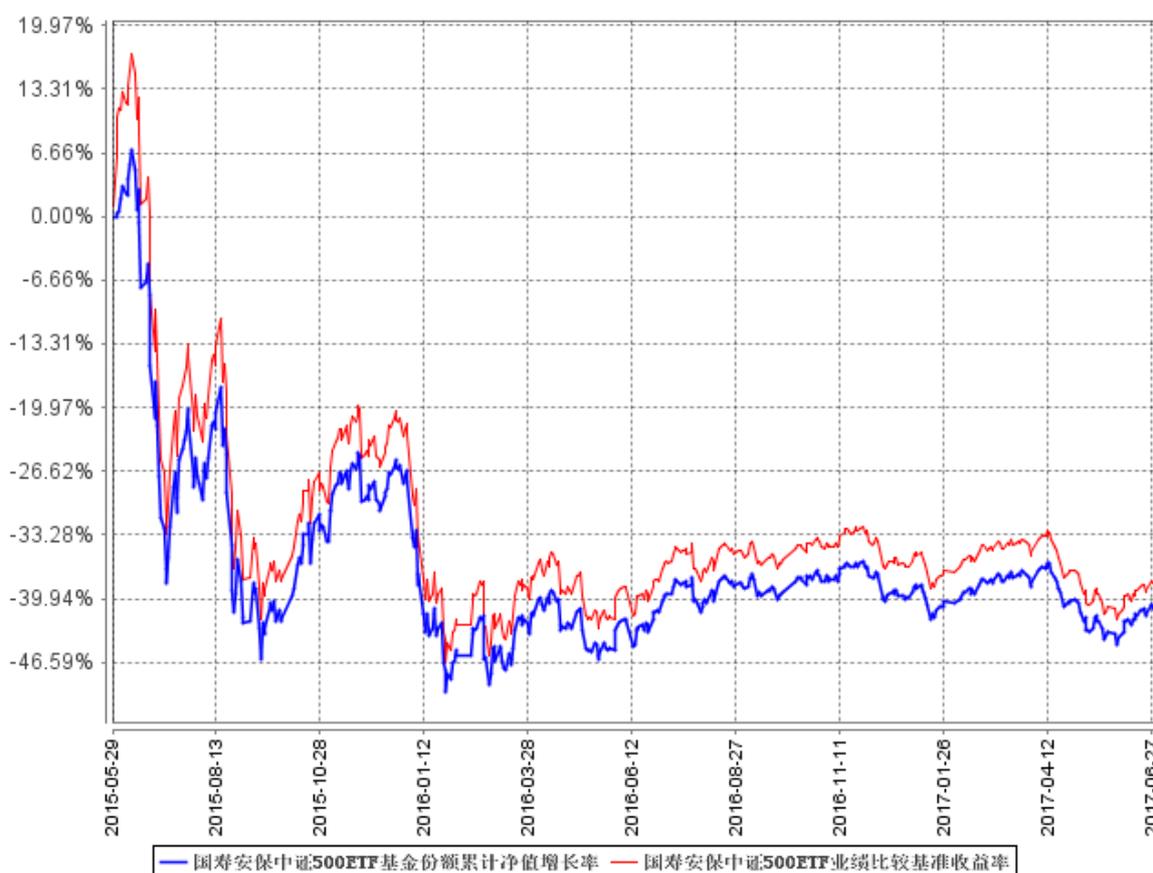
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	5.74%	0.92%	5.39%	0.93%	0.35%	-0.01%
过去三个月	-3.21%	1.01%	-4.12%	1.02%	0.91%	-0.01%
过去六个月	-0.82%	0.89%	-2.00%	0.90%	1.18%	-0.01%
过去一年	1.48%	0.89%	0.24%	0.91%	1.24%	-0.02%

自基金合同 生效起至今	-40.34%	2.19%	-37.80%	2.24%	-2.54%	-0.05%
----------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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。图示日期为2015年5月29日至2017年6月30日。

§ 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，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司共管理 31 只开放式基金及部分特定资产管理计划，公司管理资产总规模为 1410.13 亿元，其中公募基金管理规模 1006.76 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	-	7 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。

4.3.2 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 1.2885 元，累计份额净值为 0.5966 元。本报告期基金份额净值增长率为-0.82%，业绩比较基准收益率为-2.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年股市风格分化明显，小盘成长股和大盘蓝筹股走势差异显著。中证 500 指数偏中小盘成长股，受医药、传媒、计算机等板块走势疲软拖累，年初到 6 月底中证 500 指数下跌 2%。展望下半年，成长股经历上半年下跌后风险有所释放，有望逐渐企稳，有业绩支撑的优质成长股将迎来投资机遇。宏观方面经济逐渐企稳，中央金融工作会议强调金融服务实体经济，会议中强调脱虚向实、整治金融乱象，整体风险偏好维持稳定。经济政策层面，需继续关注国企改革的推进，以及党的十九大对未来五年的整体规划等。整体来看下半年 A 股市场出现大幅波动的概率不大，将以结构性行情为主。外围市场方面，美联储计划缩减资产负债表，缩表进程和加息节奏值得关注。

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其适用性的情况时，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债券品种的估值数据。

4.7 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。

4.8 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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》等相关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,550,168.32	2,218,971.22
结算备付金		-	-
存出保证金		21,304.37	99,907.12
交易性金融资产	6.4.7.2	237,878,576.79	263,627,678.04
其中：股票投资		237,878,576.79	263,627,678.04
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		96,441.89	-
应收利息	6.4.7.5	472.25	507.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		240,546,963.62	265,947,063.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	8,894.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		95,682.95	114,935.19
应付托管费		19,136.59	22,987.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,329.92	57,188.73
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	313,806.31	300,000.00
负债合计		468,955.77	504,005.35
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	402,388,698.97	441,262,934.84
未分配利润	6.4.7.10	-162,310,691.12	-175,819,876.25
所有者权益合计		240,078,007.85	265,443,058.59
负债和所有者权益总计		240,546,963.62	265,947,063.94

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.2885 元，基金份额总额 186,318,687.00 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至	2016 年 1 月 1 日至 2016

		2017 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		-89,951.83	-101,282,672.77
1.利息收入		10,350.15	21,337.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,350.15	21,321.83
债券利息收入		-	16.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,441,257.59	-92,541,611.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,757,870.64	-94,635,401.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,316,613.05	2,093,790.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	12,021,089.59	-9,324,631.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	319,866.02	562,232.00
减：二、费用		1,166,326.38	1,972,785.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	620,485.93	1,009,701.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	124,097.19	201,940.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	175,630.25	445,282.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.20	246, 113. 01	315, 860. 56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1, 256, 278. 21	-103, 255, 457. 99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1, 256, 278. 21	-103, 255, 457. 99

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	441, 262, 934. 84	-175, 819, 876. 25	265, 443, 058. 59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1, 256, 278. 21	-1, 256, 278. 21
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）	-38, 874, 235. 87	14, 765, 463. 34	-24, 108, 772. 53
其中：1. 基金申购款	77, 748, 471. 67	-29, 344, 177. 03	48, 404, 294. 64
2. 基金赎回款	-116, 622, 707. 54	44, 109, 640. 37	-72, 513, 067. 17
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）	402,388,698.97	-162,310,691.12	240,078,007.85
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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）	-	-103,255,457.99	-103,255,457.99
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）	-181,413,100.82	78,190,962.19	-103,222,138.63
其中：1. 基金申购款	99,345,269.49	-41,081,509.79	58,263,759.70
2. 基金赎回款	-280,758,370.31	119,272,471.98	-161,485,898.33
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）	557,885,642.49	-229,899,171.01	327,986,471.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

基金管理人负责人

左季庆

主管会计工作负责人

韩占锋

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“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基金管理有限公司，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。

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。

6.4.2 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

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。

6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2, 550, 168. 32
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,550,168.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	276,268,941.59	237,878,576.79	-38,390,364.80
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	276,268,941.59	237,878,576.79	-38,390,364.80

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	462.65
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	-
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	9.60
合计	472.25

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	40,329.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,329.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	263,806.31
应付指数使用费	50,000.00
-	-
合计	313,806.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	204,318,687.00	441,262,934.84
本期申购	36,000,000.00	77,748,471.67
本期赎回(以“-”号填列)	-54,000,000.00	-116,622,707.54
- 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	186,318,687.00	402,388,698.97

6.4.7.10 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	-145,407,131.09	-30,412,745.16	-175,819,876.25
本期利润	-13,277,367.80	12,021,089.59	-1,256,278.21
本期基金份额交易产生的变动数	12,907,818.18	1,857,645.16	14,765,463.34
其中：基金申购款	-26,984,684.85	-2,359,492.18	-29,344,177.03
基金赎回款	39,892,503.03	4,217,137.34	44,109,640.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-145,776,680.71	-16,534,010.41	-162,310,691.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	活期存款利息收入

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	745.72
其他	237.05
合计	10,350.15

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,679,713.63
股票投资收益——赎回差价收入	-5,078,157.01
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-13,757,870.64

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	66,240,052.05
减：卖出股票成本总额	74,919,765.68
买卖股票差价收入	-8,679,713.63

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	72,513,067.17
减：现金支付赎回款总额	38,076,773.17
减：赎回股票成本总额	39,514,451.01

赎回差价收入	-5,078,157.01
--------	---------------

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本报告期间无债券投资产生的收益/损失。

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.14 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。

6.4.7.15 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,316,613.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,316,613.05

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	12,021,089.59
——股票投资	12,021,089.59
——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	12,021,089.59

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	319,866.02
其他	-
合计	319,866.02

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	175,630.25
银行间市场交易费用	-
合计	175,630.25

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	89,258.34
银行费用	2,306.70
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
其他	-

合计	246,113.01
----	------------

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	基金托管人
国寿安保中证 500ETF 联接基金（简称“联接基金”）	公司管理的其他基金

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	620,485.93	1,009,701.80
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

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	124,097.19	201,940.35

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

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 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		上年度末	
	2017 年 6 月 30 日		2016 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

国寿安保中证 500ETF 联接基金	181,486,286.00	97.41%	183,486,286.00	89.80%
-----------------------	----------------	--------	----------------	--------

6.4.10.4 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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	2,550,168.32	9,367.38	34,440,462.06	21,321.83

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月	2017年7	新股流	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

		27日	月5日	通受限						
603617	君禾股份	2017年6月 23日	2017年7 月3日	新股流 通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

6.4.12.2 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
000656	金科股份	2017年5 月5日	公告重大 事项	6.54	2017年7月 5日	5.92	229,600	1,249,182.71	1,501,584.00	-
600643	爱建集团	2017年4 月17日	公告重大 事项	14.98	2017年8月 2日	16.48	70,950	1,076,201.72	1,062,831.00	-
002168	深圳惠程	2017年1 月23日	公告重大 事项	16.99	-	-	55,100	806,049.52	936,149.00	-
000887	中鼎股份	2017年4 月27日	公告重大 事项	22.09	2017年7月 14日	19.88	42,300	1,206,223.05	934,407.00	-
300088	长信科技	2016年9 月12日	公告重大 事项	15.75	2017年8月 9日	14.50	55,800	810,719.73	878,850.00	-
600673	东阳光科	2016年11 月15日	公告重大 事项	7.29	-	-	109,400	884,195.69	797,526.00	-
600655	豫园商城	2016年12 月20日	公告重大 事项	11.32	-	-	60,730	974,350.59	687,463.60	-
002013	中航机电	2017年5 月12日	公告重大 事项	10.33	2017年8月 2日	11.36	59,383	672,734.26	613,426.39	-
300134	大富科技	2017年2 月9日	公告重大 事项	23.36	-	-	25,536	873,549.76	596,520.96	-
002127	南极电商	2017年6 月29日	公告重大 事项	12.08	2017年7月 6日	12.61	45,200	561,384.00	546,016.00	-
002399	海普瑞	2017年4 月28日	公告重大 事项	20.23	-	-	23,400	435,356.89	473,382.00	-
601717	郑煤机	2017年4 月24日	公告重大 事项	7.79	-	-	59,000	549,166.00	459,610.00	-
002025	航天电器	2016年9 月12日	公告重大 事项	24.95	2017年7月 4日	22.46	17,720	467,974.73	442,114.00	-
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	-
300291	华录百纳	2017年4 月19日	公告重大 事项	20.02	-	-	20,122	643,296.90	402,842.44	-
600277	亿利洁能	2017年3 月6日	公告重大 事项	7.83	-	-	50,700	335,428.31	396,981.00	-
002358	森源电气	2017年5	公告重大	17.02	2017年7月	16.68	23,200	470,623.17	394,864.00	-

		月12日	事项		12日					
002642	荣之联	2017年4月10日	公告重大事项	25.06	2017年7月7日	22.54	15,350	499,058.84	384,671.00	-
600545	新疆城建	2017年6月22日	公告重大事项	11.96	2017年7月3日	12.44	31,800	464,629.45	380,328.00	-
002122	天马股份	2017年4月24日	公告重大事项	10.30	2017年7月24日	11.15	36,400	330,369.32	374,920.00	-
000061	农产品	2017年6月28日	公告重大事项	9.06	-	-	39,800	361,921.00	360,588.00	-
002505	大康农业	2017年3月13日	公告重大事项	3.50	-	-	91,070	344,131.94	318,745.00	-
002128	露天煤业	2017年3月17日	公告重大事项	8.70	2017年8月14日	9.57	36,440	355,630.26	317,028.00	-
600289	亿阳信通	2017年5月10日	公告重大事项	10.94	2017年8月18日	12.03	26,800	508,574.61	293,192.00	-
000099	中信海直	2017年5月4日	公告重大事项	11.26	-	-	25,900	405,149.10	291,634.00	-
600460	士兰微	2017年5月12日	公告重大事项	6.07	2017年8月15日	6.68	47,100	405,418.44	285,897.00	-
002681	奋达科技	2017年6月22日	公告重大事项	12.59	2017年7月3日	12.70	22,060	384,931.54	277,735.40	-
600657	信达地产	2017年2月20日	公告重大事项	5.76	2017年8月10日	6.19	46,300	318,167.66	266,688.00	-
601001	大同煤业	2017年6月22日	公告重大事项	5.25	2017年7月21日	5.78	49,200	368,857.19	258,300.00	-
600468	百利电气	2017年5月16日	公告重大事项	6.50	-	-	20,400	273,875.54	132,600.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,550,168.32	-	-	-	2,550,168.32
存出保证金	21,304.37	-	-	-	21,304.37
交易性金融资产	-	-	-	237,878,576.79	237,878,576.79
应收证券清算款	-	-	-	96,441.89	96,441.89
应收利息	-	-	-	472.25	472.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,571,472.69	-	-	237,975,490.93	240,546,963.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	95,682.95	95,682.95
应付托管费	-	-	-	19,136.59	19,136.59
应付交易费用	-	-	-	40,329.92	40,329.92
其他负债	-	-	-	313,806.31	313,806.31
负债总计	-	-	-	468,955.77	468,955.77
利率敏感度缺口	2,571,472.69	-	-	-237,506,535.16	240,078,007.85
上年度末 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

6.4.13.4.1.2 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，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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	237,878,576.79	99.08	263,627,678.04	99.32
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	237,878,576.79	99.08	263,627,678.04	99.32

6.4.13.4.3.2 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 系数是自基金合同生效日至 2017 年 6 月 30 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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	11,608,356.51	12,834,818.50

	-5%	-11,608,356.51	-12,834,818.50
--	-----	----------------	----------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 222,395,433.00 元，属于第二层次的余额为人民币 15,483,143.79 元，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

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	237,878,576.79	98.89
	其中：股票	237,878,576.79	98.89
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	2,550,168.32	1.06
7	其他各项资产	118,218.51	0.05
8	合计	240,546,963.62	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,954,475.30	1.23
B	采矿业	7,816,914.25	3.26
C	制造业	148,977,316.24	62.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,091,798.10	3.37
E	建筑业	6,076,476.09	2.53
F	批发和零售业	12,017,962.60	5.01
G	交通运输、仓储和邮政业	6,278,636.75	2.62
H	住宿和餐饮业	254,740.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,202,029.77	6.75

J	金融业	2,665,599.00	1.11
K	房地产业	14,771,299.92	6.15
L	租赁和商务服务业	4,422,408.87	1.84
M	科学研究和技术服务业	573,986.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	2,050,781.80	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	278,166.00	0.12
Q	卫生和社会工作	606,548.80	0.25
R	文化、体育和娱乐业	2,753,501.50	1.15
S	综合	1,085,935.80	0.45
	合计	237,878,576.79	99.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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。

7.3 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	300136	信维通信	46,200	1,848,924.00	0.77
2	000656	金科股份	229,600	1,501,584.00	0.63
3	002460	赣锋锂业	31,000	1,433,750.00	0.60
4	600487	亨通光电	51,100	1,433,355.00	0.60
5	002572	索菲亚	32,578	1,335,698.00	0.56
6	600201	生物股份	36,100	1,284,077.00	0.53
7	601012	隆基股份	70,300	1,202,130.00	0.50
8	300156	神雾环保	35,700	1,169,532.00	0.49
9	002271	东方雨虹	31,200	1,157,520.00	0.48
10	600176	中国巨石	102,868	1,129,490.64	0.47
11	600219	南山铝业	326,250	1,105,987.50	0.46
12	600643	爱建集团	70,950	1,062,831.00	0.44
13	603799	华友钴业	17,400	1,057,572.00	0.44

14	600525	长园集团	77,380	1,051,594.20	0.44
15	002405	四维图新	52,700	1,041,352.00	0.43
16	600079	人福医药	52,920	1,038,290.40	0.43
17	000661	长春高新	8,030	1,036,753.30	0.43
18	600315	上海家化	31,700	1,028,665.00	0.43
19	000050	深天马 A	49,400	1,016,158.00	0.42
20	600642	申能股份	160,000	1,008,000.00	0.42
21	600584	长电科技	60,900	977,445.00	0.41
22	000998	隆平高科	44,290	975,265.80	0.41
23	002092	中泰化学	75,702	961,415.40	0.40
24	002340	格林美	157,078	950,321.90	0.40
25	002168	深圳惠程	55,100	936,149.00	0.39
26	000066	长城电脑	103,898	936,120.98	0.39
27	000887	中鼎股份	42,300	934,407.00	0.39
28	300115	长盈精密	31,880	930,258.40	0.39
29	300266	兴源环境	30,000	921,600.00	0.38
30	300296	利亚德	47,900	900,520.00	0.38
31	300088	长信科技	55,800	878,850.00	0.37
32	000997	新大陆	38,619	876,265.11	0.36
33	002050	三花股份	52,900	863,328.00	0.36
34	600516	方大炭素	60,700	863,154.00	0.36
35	601168	西部矿业	112,066	861,787.54	0.36
36	600291	西水股份	38,500	847,000.00	0.35
37	600879	航天电子	96,000	843,840.00	0.35
38	002422	科伦药业	50,800	839,216.00	0.35
39	000786	北新建材	52,600	833,184.00	0.35
40	600325	华发股份	99,570	831,409.50	0.35
41	600056	中国医药	31,400	814,830.00	0.34

42	002407	多氟多	36,900	811,431.00	0.34
43	600266	北京城建	55,318	804,323.72	0.34
44	000039	中集集团	44,400	800,532.00	0.33
45	600673	东阳光科	109,400	797,526.00	0.33
46	600022	山东钢铁	385,970	795,098.20	0.33
47	600839	四川长虹	217,000	785,540.00	0.33
48	000778	新兴铸管	117,000	783,900.00	0.33
49	600426	华鲁恒升	66,675	782,764.50	0.33
50	600388	龙净环保	50,300	781,159.00	0.33
51	600166	福田汽车	274,500	779,580.00	0.32
52	600521	华海药业	36,790	774,061.60	0.32
53	600161	天坛生物	19,760	766,885.60	0.32
54	000581	威孚高科	29,600	766,640.00	0.32
55	600435	北方导航	52,500	751,275.00	0.31
56	600528	中铁工业	52,200	745,938.00	0.31
57	002410	广联达	39,500	742,600.00	0.31
58	000970	中科三环	50,100	740,478.00	0.31
59	000999	华润三九	23,100	733,425.00	0.31
60	002179	中航光电	23,298	726,664.62	0.30
61	002217	合力泰	73,500	726,180.00	0.30
62	600138	中青旅	34,100	718,146.00	0.30
63	002366	台海核电	15,300	717,723.00	0.30
64	600600	青岛啤酒	20,400	716,040.00	0.30
65	600699	均胜电子	22,300	715,607.00	0.30
66	002573	清新环境	37,600	707,632.00	0.29
67	002038	双鹭药业	24,200	705,430.00	0.29
68	000028	国药一致	8,700	703,830.00	0.29
69	600978	宜华生活	69,800	701,490.00	0.29

70	002223	鱼跃医疗	29,550	699,744.00	0.29
71	601000	唐山港	133,920	699,062.40	0.29
72	600260	凯乐科技	27,433	695,152.22	0.29
73	300383	光环新网	51,000	691,560.00	0.29
74	600655	豫园商城	60,730	687,463.60	0.29
75	600614	鹏起科技	62,100	683,100.00	0.28
76	002311	海大集团	37,240	680,374.80	0.28
77	603589	口子窖	17,528	679,911.12	0.28
78	600158	中体产业	39,700	678,870.00	0.28
79	000488	晨鸣纸业	52,400	675,960.00	0.28
80	300002	神州泰岳	80,600	672,204.00	0.28
81	002583	海能达	41,000	659,690.00	0.27
82	000878	云南铜业	50,000	659,500.00	0.27
83	300113	顺网科技	24,500	659,050.00	0.27
84	002078	太阳纸业	89,400	657,090.00	0.27
85	002004	华邦健康	83,750	655,762.50	0.27
86	300055	万邦达	35,600	655,040.00	0.27
87	600511	国药股份	18,000	652,320.00	0.27
88	002030	达安基因	29,880	651,085.20	0.27
89	600503	华丽家族	94,200	650,922.00	0.27
90	000566	海南海药	49,000	649,740.00	0.27
91	002019	亿帆医药	38,800	647,184.00	0.27
92	002273	水晶光电	31,200	643,656.00	0.27
93	000400	许继电气	35,600	639,376.00	0.27
94	603019	中科曙光	22,600	635,964.00	0.26
95	002244	滨江集团	91,400	632,488.00	0.26
96	600298	安琪酵母	24,250	627,347.50	0.26
97	600392	盛和资源	47,550	627,184.50	0.26

98	600755	厦门国贸	68,500	624,720.00	0.26
99	002384	东山精密	25,200	622,440.00	0.26
100	002001	新和成	32,000	621,120.00	0.26
101	600808	马钢股份	175,436	621,043.44	0.26
102	600635	大众公用	113,800	620,210.00	0.26
103	300324	旋极信息	33,800	616,512.00	0.26
104	600717	天津港	49,300	615,757.00	0.26
105	000547	航天发展	58,900	615,505.00	0.26
106	002013	中航机电	59,383	613,426.39	0.26
107	000930	中粮生化	56,700	611,226.00	0.25
108	000401	冀东水泥	39,600	609,444.00	0.25
109	000418	小天鹅A	13,000	608,270.00	0.25
110	300244	迪安诊断	19,280	606,548.80	0.25
111	600240	华业资本	66,900	606,114.00	0.25
112	601231	环旭电子	38,400	603,264.00	0.25
113	600122	宏图高科	54,300	602,730.00	0.25
114	002176	江特电机	69,000	601,680.00	0.25
115	600872	中炬高新	32,800	600,240.00	0.25
116	600160	巨化股份	49,700	597,891.00	0.25
117	002491	通鼎互联	44,400	596,736.00	0.25
118	300134	大富科技	25,536	596,520.96	0.25
119	300146	汤臣倍健	43,200	593,568.00	0.25
120	600633	浙数文化	30,700	593,124.00	0.25
121	000598	兴蓉环境	105,400	592,348.00	0.25
122	300058	蓝色光标	75,500	590,410.00	0.25
123	002439	启明星辰	31,700	589,620.00	0.25
124	000960	锡业股份	43,300	589,313.00	0.25
125	600418	江淮汽车	55,700	587,635.00	0.24

126	002601	佰利联	35,800	586,404.00	0.24
127	600500	中化国际	61,300	586,028.00	0.24
128	600062	华润双鹤	21,300	584,259.00	0.24
129	000825	太钢不锈	134,000	582,900.00	0.24
130	300159	新研股份	43,800	579,912.00	0.24
131	600143	金发科技	95,900	578,277.00	0.24
132	002408	齐翔腾达	52,181	578,165.48	0.24
133	002400	省广股份	71,779	576,385.37	0.24
134	000685	中山公用	52,000	569,400.00	0.24
135	600594	益佰制药	37,300	569,198.00	0.24
136	002354	天神娱乐	26,400	567,600.00	0.24
137	000513	丽珠集团	8,297	565,025.70	0.24
138	000089	深圳机场	60,300	563,805.00	0.23
139	000078	海王生物	93,400	563,202.00	0.23
140	000729	燕京啤酒	82,800	556,416.00	0.23
141	000979	中弘股份	211,400	553,868.00	0.23
142	601699	潞安环能	70,400	550,528.00	0.23
143	600312	平高电气	39,900	548,226.00	0.23
144	600409	三友化工	54,400	547,808.00	0.23
145	600811	东方集团	84,000	547,680.00	0.23
146	002127	南极电商	45,200	546,016.00	0.23
147	000926	福星股份	44,600	544,120.00	0.23
148	002051	中工国际	26,229	543,727.17	0.23
149	600881	亚泰集团	107,000	543,560.00	0.23
150	600884	杉杉股份	33,000	543,510.00	0.23
151	600967	内蒙一机	39,797	542,433.11	0.23
152	300122	智飞生物	28,300	540,813.00	0.23
153	000697	炼石有色	26,400	540,408.00	0.23

154	600566	济川药业	14,200	540,026.00	0.22
155	601880	大连港	181,940	538,542.40	0.22
156	600970	中材国际	61,900	537,911.00	0.22
157	002640	跨境通	25,300	537,625.00	0.22
158	002431	棕榈股份	48,600	535,572.00	0.22
159	000988	华工科技	36,700	535,453.00	0.22
160	000690	宝新能源	89,500	535,210.00	0.22
161	600026	中远海能	80,459	533,443.17	0.22
162	002701	奥瑞金	83,080	530,881.20	0.22
163	600809	山西汾酒	15,300	530,757.00	0.22
164	002373	千方科技	38,900	530,596.00	0.22
165	600499	科达洁能	66,420	527,374.80	0.22
166	600183	生益科技	42,700	526,918.00	0.22
167	600307	酒钢宏兴	184,100	524,685.00	0.22
168	000806	银河生物	38,800	523,800.00	0.22
169	002390	信邦制药	60,100	523,471.00	0.22
170	002048	宁波华翔	25,000	521,500.00	0.22
171	600664	哈药股份	89,626	520,727.06	0.22
172	002221	东华能源	47,700	520,407.00	0.22
173	002512	达华智能	32,100	518,415.00	0.22
174	000600	建投能源	42,200	517,794.00	0.22
175	600863	内蒙华电	170,700	513,807.00	0.21
176	300253	卫宁健康	65,730	513,351.30	0.21
177	600094	大名城	66,900	513,123.00	0.21
178	600787	中储股份	64,700	511,777.00	0.21
179	600572	康恩贝	73,854	511,069.68	0.21
180	000012	南玻A	54,079	504,557.07	0.21
181	002191	劲嘉股份	53,800	503,568.00	0.21

182	000592	平潭发展	90,800	501,216.00	0.21
183	600874	创业环保	25,600	500,992.00	0.21
184	002665	首航节能	69,510	500,472.00	0.21
185	300026	红日药业	106,200	500,202.00	0.21
186	002028	思源电气	31,320	499,240.80	0.21
187	002635	安洁科技	13,783	499,220.26	0.21
188	000667	美好集团	150,500	498,155.00	0.21
189	000816	智慧农业	66,800	496,992.00	0.21
190	300166	东方国信	36,978	496,614.54	0.21
191	002603	以岭药业	28,300	494,118.00	0.21
192	600478	科力远	57,304	493,387.44	0.21
193	002444	巨星科技	31,600	492,328.00	0.21
194	300001	特锐德	29,300	491,068.00	0.20
195	000006	深振业 A	55,600	489,836.00	0.20
196	002477	雏鹰农牧	110,500	489,515.00	0.20
197	600017	日照港	108,500	488,250.00	0.20
198	000758	中色股份	69,500	487,195.00	0.20
199	000732	泰禾集团	29,199	487,039.32	0.20
200	000975	银泰资源	38,231	482,857.53	0.20
201	600125	铁龙物流	53,800	482,048.00	0.20
202	000031	中粮地产	64,000	481,920.00	0.20
203	600120	浙江东方	17,900	481,152.00	0.20
204	600064	南京高科	31,800	480,180.00	0.20
205	603077	和邦生物	94,300	479,987.00	0.20
206	600348	阳泉煤业	70,700	479,346.00	0.20
207	002672	东江环保	28,350	478,831.50	0.20
208	002399	海普瑞	23,400	473,382.00	0.20
209	000158	常山股份	29,900	472,420.00	0.20

210	600565	迪马股份	85,700	472,207.00	0.20
211	000939	凯迪生态	92,400	471,240.00	0.20
212	000860	顺鑫农业	23,500	470,235.00	0.20
213	000027	深圳能源	69,800	469,754.00	0.20
214	000563	陕国投 A	90,800	469,436.00	0.20
215	002250	联化科技	32,700	467,610.00	0.19
216	300287	飞利信	50,600	464,508.00	0.19
217	600198	大唐电信	36,300	463,551.00	0.19
218	300274	阳光电源	41,620	461,565.80	0.19
219	600597	光明乳业	36,200	461,550.00	0.19
220	600410	华胜天成	52,020	460,897.20	0.19
221	300116	坚瑞消防	42,800	460,100.00	0.19
222	000877	天山股份	36,300	459,921.00	0.19
223	601717	郑煤机	59,000	459,610.00	0.19
224	002261	拓维信息	39,200	459,032.00	0.19
225	600416	湘电股份	33,400	457,580.00	0.19
226	002468	艾迪西	17,900	454,839.00	0.19
227	002308	威创股份	34,800	454,140.00	0.19
228	002266	浙富控股	92,980	453,742.40	0.19
229	603766	隆鑫通用	62,150	452,452.00	0.19
230	000727	华东科技	159,800	452,234.00	0.19
231	600687	刚泰控股	35,000	450,800.00	0.19
232	600200	江苏吴中	33,900	447,480.00	0.19
233	600582	天地科技	97,200	446,148.00	0.19
234	002353	杰瑞股份	28,200	446,124.00	0.19
235	002002	鸿达兴业	56,908	445,589.64	0.19
236	002517	恺英网络	12,600	443,394.00	0.18
237	600039	四川路桥	106,562	443,297.92	0.18

238	601929	吉视传媒	128,000	442,880.00	0.18
239	002025	航天电器	17,720	442,114.00	0.18
240	601928	凤凰传媒	44,800	437,248.00	0.18
241	600466	蓝光发展	50,200	433,226.00	0.18
242	600557	康缘药业	26,060	432,856.60	0.18
243	600282	南钢股份	116,500	432,215.00	0.18
244	600751	天海投资	75,700	430,733.00	0.18
245	600086	东方金钰	39,700	429,157.00	0.18
246	601689	拓普集团	12,800	428,672.00	0.18
247	002544	杰赛科技	18,800	428,640.00	0.18
248	002396	星网锐捷	22,100	427,635.00	0.18
249	603000	人民网	32,400	426,708.00	0.18
250	300257	开山股份	20,200	425,816.00	0.18
251	600380	健康元	46,700	424,036.00	0.18
252	002375	亚厦股份	47,300	421,443.00	0.18
253	002670	国盛金控	26,360	419,124.00	0.17
254	002022	科华生物	24,100	418,617.00	0.17
255	000501	鄂武商 A	22,670	418,488.20	0.17
256	600151	航天机电	50,600	416,438.00	0.17
257	000693	ST 华泽	33,300	416,250.00	0.17
258	000830	鲁西化工	60,300	416,070.00	0.17
259	002268	卫士通	24,700	415,454.00	0.17
260	000519	江南红箭	32,962	415,321.20	0.17
261	300199	翰宇药业	27,001	414,195.34	0.17
262	002440	闰土股份	27,100	413,546.00	0.17
263	002589	瑞康医药	26,590	409,486.00	0.17
264	002281	光迅科技	18,400	408,848.00	0.17
265	002489	浙江永强	63,950	408,001.00	0.17

266	600169	太原重工	105,400	406,844.00	0.17
267	000703	恒逸石化	28,562	406,722.88	0.17
268	600316	洪都航空	25,300	406,571.00	0.17
269	600611	大众交通	73,600	406,272.00	0.17
270	002155	湖南黄金	42,404	405,806.28	0.17
271	600366	宁波韵升	23,000	405,720.00	0.17
272	600694	大商股份	10,400	405,288.00	0.17
273	002368	太极股份	14,600	404,274.00	0.17
274	600759	洲际油气	66,590	403,535.40	0.17
275	600270	外运发展	21,300	403,209.00	0.17
276	300291	华录百纳	20,122	402,842.44	0.17
277	600835	上海机电	19,000	401,660.00	0.17
278	000528	柳 工	46,338	400,360.32	0.17
279	002657	中科金财	13,800	400,062.00	0.17
280	600267	海正药业	34,100	398,288.00	0.17
281	002342	巨力索具	39,500	397,765.00	0.17
282	600277	亿利洁能	50,700	396,981.00	0.17
283	600563	法拉电子	8,000	395,280.00	0.16
284	000612	焦作万方	49,100	395,255.00	0.16
285	002358	森源电气	23,200	394,864.00	0.16
286	600108	亚盛集团	91,600	394,796.00	0.16
287	300273	和佳股份	32,318	392,986.88	0.16
288	600187	国中水务	77,800	392,890.00	0.16
289	000090	天健集团	35,280	391,608.00	0.16
290	002709	天赐材料	9,500	391,115.00	0.16
291	600645	中源协和	18,200	390,026.00	0.16
292	002503	搜于特	55,160	387,774.80	0.16
293	601678	滨化股份	55,760	387,532.00	0.16

294	600993	马应龙	17,790	387,466.20	0.16
295	600729	重庆百货	14,400	386,496.00	0.16
296	002285	世联行	48,159	386,235.18	0.16
297	002642	荣之联	15,350	384,671.00	0.16
298	600848	上海临港	17,800	383,768.00	0.16
299	000937	冀中能源	62,400	381,888.00	0.16
300	600098	广州发展	48,100	380,471.00	0.16
301	600545	新疆城建	31,800	380,328.00	0.16
302	600765	中航重机	27,500	378,950.00	0.16
303	000049	德赛电池	7,300	378,213.00	0.16
304	002437	誉衡药业	51,757	376,790.96	0.16
305	002122	天马股份	36,400	374,920.00	0.16
306	002325	洪涛股份	51,170	373,541.00	0.16
307	000587	金洲慈航	25,000	372,500.00	0.16
308	000021	深科技	43,300	371,514.00	0.15
309	000810	创维数字	30,500	369,965.00	0.15
310	600073	上海梅林	38,675	369,346.25	0.15
311	600422	昆药集团	32,500	368,550.00	0.15
312	600750	江中药业	10,600	368,350.00	0.15
313	000543	皖能电力	63,170	368,281.10	0.15
314	300376	易事特	40,600	368,242.00	0.15
315	002011	盾安环境	32,372	367,422.20	0.15
316	600300	维维股份	68,800	367,392.00	0.15
317	002018	华信国际	53,600	367,160.00	0.15
318	002249	大洋电机	55,700	366,506.00	0.15
319	000829	天音控股	33,900	366,120.00	0.15
320	000766	通化金马	22,700	362,746.00	0.15
321	000669	金鸿能源	20,000	362,600.00	0.15

322	002056	横店东磁	48,300	362,250.00	0.15
323	000777	中核科技	18,100	361,276.00	0.15
324	000061	农产品	39,800	360,588.00	0.15
324	600639	浦东金桥	19,900	360,588.00	0.15
325	601016	节能风电	97,600	359,168.00	0.15
326	002317	众生药业	28,800	357,696.00	0.15
327	000897	津滨发展	76,100	357,670.00	0.15
328	000636	风华高科	42,000	357,420.00	0.15
329	002242	九阳股份	18,126	356,538.42	0.15
330	603188	亚邦股份	20,400	355,776.00	0.15
331	601311	骆驼股份	25,000	354,000.00	0.15
332	000572	海马汽车	67,700	350,009.00	0.15
333	600284	浦东建设	32,600	349,472.00	0.15
334	000762	西藏矿业	24,550	347,873.50	0.14
335	600259	广晟有色	8,900	347,456.00	0.14
336	000596	古井贡酒	6,800	346,460.00	0.14
337	600651	飞乐音响	40,900	346,423.00	0.14
338	000848	承德露露	34,590	345,208.20	0.14
339	600770	综艺股份	45,900	344,250.00	0.14
340	600496	精工钢构	71,100	343,413.00	0.14
341	603444	吉比特	1,200	339,996.00	0.14
342	600587	新华医疗	19,100	339,598.00	0.14
343	000062	深圳华强	12,800	339,584.00	0.14
344	600216	浙江医药	34,000	336,940.00	0.14
345	002123	梦网荣信	30,300	336,633.00	0.14
346	002106	莱宝高科	33,200	336,316.00	0.14
347	600536	中国软件	17,500	335,300.00	0.14
348	002276	万马股份	33,200	334,988.00	0.14

349	002479	富春环保	28,100	334,390.00	0.14
350	002254	泰和新材	25,140	334,362.00	0.14
351	300010	立思辰	25,700	332,815.00	0.14
352	002064	华峰氨纶	68,900	332,098.00	0.14
353	002073	软控股份	38,700	328,176.00	0.14
354	002482	广田集团	36,500	328,135.00	0.14
355	002428	云南锗业	30,700	327,876.00	0.14
356	002707	众信旅游	24,800	325,624.00	0.14
357	600458	时代新材	28,300	324,035.00	0.13
358	002332	仙琚制药	37,650	323,790.00	0.13
359	600171	上海贝岭	31,700	322,389.00	0.13
360	000652	泰达股份	60,800	322,240.00	0.13
361	002505	大康农业	91,070	318,745.00	0.13
362	000680	山推股份	58,400	318,280.00	0.13
363	000620	新华联	44,600	317,106.00	0.13
364	002128	露天煤业	36,440	317,028.00	0.13
365	000541	佛山照明	34,600	315,206.00	0.13
366	000969	安泰科技	36,100	315,153.00	0.13
367	000726	鲁泰 A	26,500	314,290.00	0.13
368	600428	中远海特	50,499	314,103.78	0.13
369	002463	沪电股份	68,900	313,495.00	0.13
370	600058	五矿发展	25,245	313,290.45	0.13
371	001696	宗申动力	40,400	305,828.00	0.13
372	002690	美亚光电	15,900	304,962.00	0.13
373	600329	中新药业	16,800	304,248.00	0.13
374	300297	蓝盾股份	27,700	303,315.00	0.13
375	601233	桐昆股份	21,809	302,272.74	0.13
376	600517	置信电气	39,900	302,043.00	0.13

377	603883	老百姓	6,200	301,630.00	0.13
378	300043	星辉娱乐	36,501	299,673.21	0.12
379	600894	广日股份	25,300	299,552.00	0.12
380	600736	苏州高新	42,200	298,354.00	0.12
381	601777	力帆股份	37,000	297,480.00	0.12
382	000426	兴业矿业	32,900	296,758.00	0.12
383	002063	远光软件	28,350	295,407.00	0.12
384	600859	王府井	18,260	294,899.00	0.12
385	600805	悦达投资	40,028	294,205.80	0.12
386	603556	海兴电力	6,700	294,063.00	0.12
387	600586	金晶科技	60,100	293,889.00	0.12
388	600790	轻纺城	43,150	293,851.50	0.12
389	600880	博瑞传播	45,000	293,850.00	0.12
390	600289	亿阳信通	26,800	293,192.00	0.12
391	603369	今世缘	22,200	293,040.00	0.12
392	600338	西藏珠峰	7,700	292,523.00	0.12
393	000099	中信海直	25,900	291,634.00	0.12
394	603888	新华网	9,000	291,510.00	0.12
395	000616	海航投资	67,300	289,390.00	0.12
396	000552	靖远煤电	80,700	288,099.00	0.12
397	600220	江苏阳光	83,900	287,777.00	0.12
398	002663	普邦园林	52,700	286,161.00	0.12
399	600460	士兰微	47,100	285,897.00	0.12
400	600395	盘江股份	39,000	285,870.00	0.12
401	600720	祁连山	36,507	285,849.81	0.12
402	600773	西藏城投	25,700	284,499.00	0.12
403	603816	顾家家居	4,800	282,144.00	0.12
404	002727	一心堂	15,300	281,520.00	0.12

405	300147	香雪制药	27,300	280,371.00	0.12
406	601886	江河集团	27,200	278,800.00	0.12
407	603377	东方时尚	7,400	278,166.00	0.12
408	002681	奋达科技	22,060	277,735.40	0.12
409	603355	莱克电气	4,700	276,219.00	0.12
410	002269	美邦服饰	73,900	275,647.00	0.11
411	600006	东风汽车	47,100	275,535.00	0.11
412	300039	上海凯宝	37,840	275,096.80	0.11
413	002041	登海种业	20,750	274,937.50	0.11
414	002005	德豪润达	57,500	274,275.00	0.11
415	002120	新海股份	5,300	273,480.00	0.11
416	002190	成飞集成	10,200	273,360.00	0.11
417	600801	华新水泥	28,600	272,558.00	0.11
418	002345	潮宏基	24,900	270,663.00	0.11
419	600596	新安股份	31,940	269,893.00	0.11
420	600053	九鼎投资	7,700	269,192.00	0.11
421	002277	友阿股份	41,700	268,965.00	0.11
422	603198	迎驾贡酒	14,100	268,323.00	0.11
423	600280	中央商场	33,800	268,034.00	0.11
424	300032	金龙机电	19,200	267,840.00	0.11
425	300202	聚龙股份	16,170	267,128.40	0.11
426	600657	信达地产	46,300	266,688.00	0.11
427	600757	长江传媒	35,700	266,679.00	0.11
428	000417	合肥百货	32,173	265,427.25	0.11
429	600059	古越龙山	28,600	264,550.00	0.11
430	600628	新世界	22,900	264,495.00	0.11
431	600869	智慧能源	39,200	263,816.00	0.11
432	002588	史丹利	34,000	261,460.00	0.11

433	600141	兴发集团	21,100	261,007.00	0.11
434	002371	七星电子	10,815	258,694.80	0.11
435	600580	卧龙电气	37,900	258,478.00	0.11
436	601001	大同煤业	49,200	258,300.00	0.11
437	000681	视觉中国	16,491	258,249.06	0.11
438	002233	塔牌集团	21,120	257,030.40	0.11
439	002147	新光圆成	16,500	256,410.00	0.11
440	600754	锦江股份	9,400	254,740.00	0.11
441	600481	双良节能	47,700	253,287.00	0.11
442	002344	海宁皮城	30,200	251,264.00	0.10
443	600292	远达环保	22,960	247,508.80	0.10
444	600195	中牧股份	12,700	246,253.00	0.10
445	601002	晋亿实业	28,000	242,200.00	0.10
446	600537	亿晶光电	48,494	241,500.12	0.10
447	600971	恒源煤电	29,400	239,022.00	0.10
448	600862	中航高科	24,600	238,374.00	0.10
449	600640	号百控股	14,100	238,290.00	0.10
450	002309	中利科技	18,900	236,439.00	0.10
451	600748	上实发展	32,620	234,864.00	0.10
452	600743	华远地产	55,160	232,775.20	0.10
453	600826	兰生股份	12,400	224,440.00	0.09
454	600184	光电股份	11,900	223,244.00	0.09
455	600251	冠农股份	27,700	220,769.00	0.09
456	002699	美盛文化	15,960	220,248.00	0.09
457	603169	兰石重装	18,100	219,915.00	0.09
458	600996	贵广网络	18,300	219,051.00	0.09
459	600335	国机汽车	18,200	217,672.00	0.09
460	600831	广电网络	21,400	212,930.00	0.09

461	002551	尚荣医疗	13,097	211,254.61	0.09
462	002392	北京利尔	35,300	209,329.00	0.09
463	002093	国脉科技	23,700	208,560.00	0.09
464	002118	紫鑫药业	30,198	206,252.34	0.09
465	002414	高德红外	11,100	203,130.00	0.08
466	002416	爱施德	18,300	197,457.00	0.08
467	600776	东方通信	28,100	190,518.00	0.08
468	002251	步步高	15,310	189,690.90	0.08
469	000536	华映科技	32,407	188,284.67	0.08
470	600551	时代出版	11,900	187,901.00	0.08
471	002646	青青稞酒	10,600	185,076.00	0.08
472	603698	航天工程	7,300	183,960.00	0.08
473	603005	晶方科技	6,558	183,558.42	0.08
474	603868	飞科电器	2,900	179,336.00	0.07
475	603001	奥康国际	9,500	178,505.00	0.07
476	000517	荣安地产	37,500	174,375.00	0.07
477	603568	伟明环保	8,050	174,041.00	0.07
478	603567	珍宝岛	10,000	168,300.00	0.07
479	000025	特力A	3,200	165,568.00	0.07
480	603328	依顿电子	11,600	164,140.00	0.07
481	600936	广西广电	19,600	158,172.00	0.07
482	603528	多伦科技	11,000	158,070.00	0.07
483	600126	杭钢股份	22,900	157,094.00	0.07
484	002807	江阴银行	12,400	155,372.00	0.06
485	603806	福斯特	4,700	150,447.00	0.06
486	600648	外高桥	8,000	148,160.00	0.06
487	600618	氯碱化工	13,300	142,044.00	0.06
488	002315	焦点科技	5,600	139,664.00	0.06

489	603866	桃李面包	3,800	135,204.00	0.06
490	603228	景旺电子	2,800	135,100.00	0.06
491	601020	华钰矿业	6,100	134,383.00	0.06
492	603515	欧普照明	3,700	133,644.00	0.06
493	600468	百利电气	20,400	132,600.00	0.06
494	000712	锦龙股份	8,000	130,960.00	0.05
495	002194	武汉凡谷	13,300	117,705.00	0.05
496	603658	安图生物	2,400	103,440.00	0.04
497	002815	崇达技术	3,100	102,424.00	0.04
498	002818	富森美	2,500	98,675.00	0.04
499	600917	重庆燃气	10,100	95,243.00	0.04
500	601811	新华文轩	6,000	93,360.00	0.04
501	000761	本钢板材	17,700	92,571.00	0.04
502	603877	太平鸟	3,300	92,367.00	0.04
503	603569	长久物流	2,500	83,575.00	0.03
504	603025	大豪科技	2,900	76,560.00	0.03
505	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
506	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
507	603043	广州酒家	1,448	36,590.96	0.02
508	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
509	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
510	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
511	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
512	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
513	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
514	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
515	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
516	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00

517	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
518	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
519	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600642	申能股份	989,104.00	0.37
2	000778	新兴铸管	816,660.00	0.31
3	603799	华友钴业	780,942.00	0.29
4	000039	中集集团	752,685.00	0.28
5	600839	四川长虹	752,168.00	0.28
6	300002	神州泰岳	675,780.65	0.25
7	300383	光环新网	644,919.00	0.24
8	002583	海能达	620,646.00	0.23
9	300058	蓝色光标	611,394.00	0.23
10	002127	南极电商	561,384.00	0.21
11	000729	燕京啤酒	553,932.00	0.21
12	002601	佰利联	545,662.00	0.21
13	600566	济川药业	540,569.00	0.20
14	300146	汤臣倍健	502,572.52	0.19
15	000027	深圳能源	483,431.00	0.18
16	000732	泰禾集团	482,153.50	0.18
17	002670	国盛金控	473,492.00	0.18
18	002517	恺英网络	440,874.00	0.17
19	002468	艾迪西	438,284.00	0.17
20	601928	凤凰传媒	434,788.00	0.16

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。

7.4.2 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	002508	老板电器	1,571,561.42	0.59
2	600522	中天科技	1,282,876.00	0.48
3	600682	南京新百	1,123,075.00	0.42
4	600436	片仔癀	1,036,398.00	0.39
5	000959	首钢股份	855,609.00	0.32
6	002602	世纪华通	850,057.00	0.32
7	002595	豪迈科技	723,185.00	0.27
8	600549	厦门钨业	692,430.00	0.26
9	000961	中南建设	661,625.00	0.25
10	600497	驰宏锌锗	608,481.98	0.23
11	600601	方正科技	505,933.96	0.19
12	000066	长城电脑	482,204.00	0.18
13	002581	未名医药	475,233.99	0.18
14	000547	航天发展	473,799.00	0.18
15	000973	佛塑科技	458,772.44	0.17
16	300026	红日药业	414,644.00	0.16
17	600067	冠城大通	409,551.00	0.15
18	600575	皖江物流	402,166.00	0.15
19	000869	张裕A	392,909.00	0.15
20	002498	汉缆股份	392,265.00	0.15

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。

7.4.3 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	53,654,236.16
卖出股票收入（成交）总额	66,240,052.05

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	21,304.37
2	应收证券清算款	96,441.89
3	应收股利	-

4	应收利息	472.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	118,218.51

7.12.4 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。

7.12.5 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	000656	金科股份	1,501,584.00	0.63	公告重大事项

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 本基金的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
463	402,416.17	181,779,498.00	97.56%	4,539,189.00	2.44%

8.2 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	何凤珍	517,366.00	0.28%
2	杨盾保	341,000.00	0.18%
3	中信证券股份有限公司	292,322.00	0.16%
4	赵彤阳	248,700.00	0.13%

5	张红艳	243,300.00	0.13%
6	姜晓平	235,683.00	0.13%
7	李敏慧	231,516.00	0.12%
8	王梅	231,279.00	0.12%
9	孙建兴	183,563.00	0.10%
10	梁利	139,400.00	0.07%
11	中国农业银行股份有限公司—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	181,486,286.00	97.41%

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。

8.3 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。

8.4 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本基金。

§ 9 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	204,318,687.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	54,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	186,318,687.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	62,054,953.94	52.47%	57,791.83	58.44%	-
兴业证券	2	28,648,017.60	24.22%	20,950.48	21.18%	-
申万宏源	2	27,562,280.49	23.31%	20,156.29	20.38%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：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。

10.8 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	国寿安保中证 500ETF 更新招募说明书（摘要）（2017 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 13 日
2	国寿安保中证 500ETF2016 年第 4 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 21 日
3	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2016 年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 3 月 28 日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 4 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20170101-20170630	183,486,286.00	36,000,000.00	38,000,000.00	181,486,286.00	97.41%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。</p> <p>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，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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 8 月 25 日