

# 国寿安保中证养老产业指数分级证券投资 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：招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
7.7 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.....	44
7.8 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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>50</b>

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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金		
基金简称	国寿安保中证养老产业指数分级		
场内简称	国寿养老		
基金主代码	168001		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 6 月 26 日		
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	155,178,292.87 份		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 10 日		
下属分级基金的基金简称	国寿安保中证养老 产业指数分级 A	国寿安保中证养老 产业指数分级 B	国寿安保中证养老 产业指数分级
下属分级基金场内简称:	养老 A	养老 B	国寿养老
下属分级基金的交易代码	150305	150306	168001
报告期末下属分级基金份额 总额	22,474,370.00 份	22,474,370.00 份	110,229,552.87 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证养老产业指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

业绩比较基准	95%中证养老产业指数收益率+5%银行人民币活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看，国寿养老 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；国寿养老 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	国寿养老 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	国寿养老 B 份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬	郭杰
	联系电话	010-50850744	0755-82943666
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95565
传真		010-50850776	0755-82960794
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
邮政编码		100033	518026
法定代表人		王军辉	霍达

### 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	-1,611,457.85
本期利润	6,420,571.26
加权平均基金份额本期利润	0.0364
本期加权平均净值利润率	4.74%
本期基金份额净值增长率	5.03%
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	-24,470,046.66
期末可供分配基金份额利润	-0.1577
期末基金资产净值	124,301,416.66
期末基金份额净值	0.801
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	-16.40%

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。



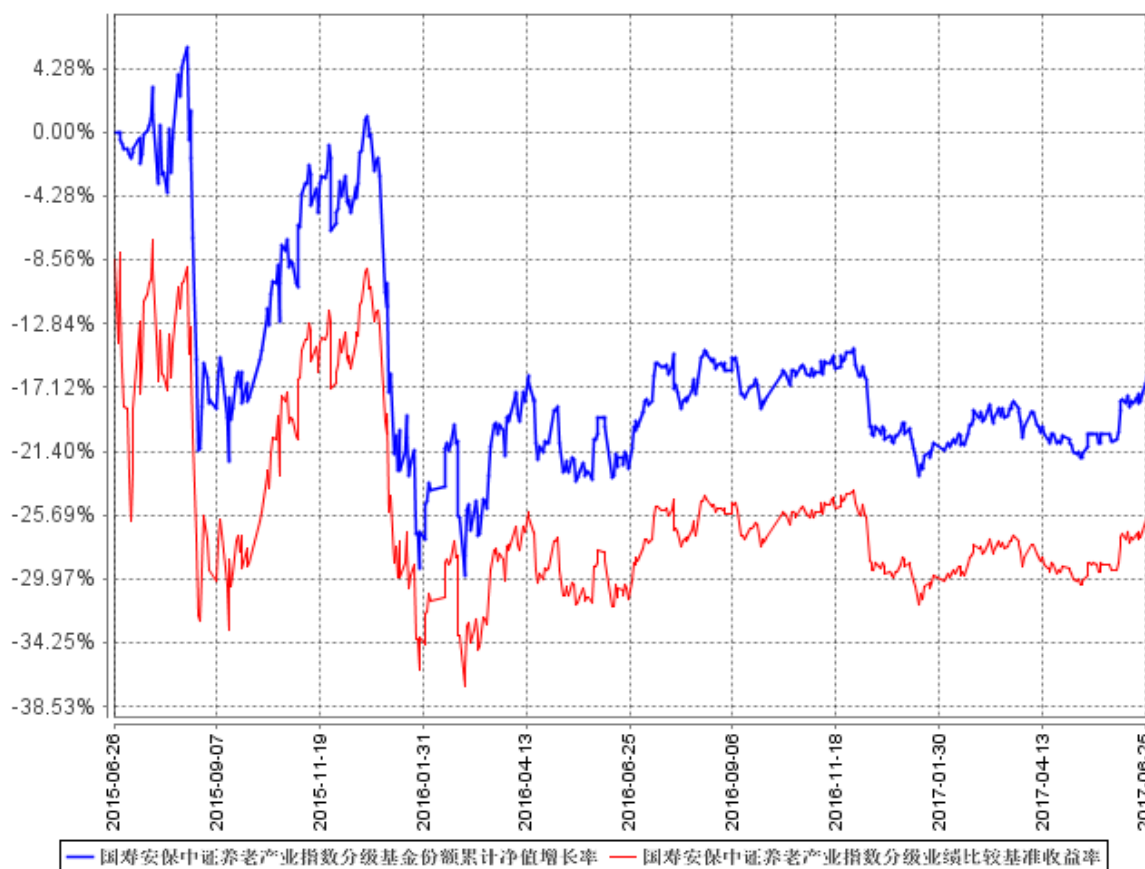
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.89%	0.64%	4.51%	0.67%	0.38%	-0.03%
过去三个月	4.24%	0.55%	3.78%	0.56%	0.46%	-0.01%
过去六个月	5.03%	0.59%	5.22%	0.60%	-0.19%	-0.01%
过去一年	3.72%	0.69%	3.77%	0.70%	-0.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-16.40%	1.65%	-25.79%	1.98%	9.39%	-0.33%

#### 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

国寿安保中证养老产业指数分级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 6 月 26 日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之

日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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 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为 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		
吴坚	基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	10 年	吴坚先生,博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理、中国人寿资产管理有限公司一级研究员,现任国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金、国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金及国寿安保稳健增利混合型证券投资基金基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，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

2017 年上半年中国经济走势稳中向好，海外经济复苏延续使得出口保持回暖态势，房地产投资与基建投资仍然维持动能，制造业投资在企业利润改善的推动下底部企稳。通胀从 1 月高位回落后处于较低水平，以猪肉为代表的食品价格走势仍然低迷，核心通胀则跟随房价和工业品价格下降。政策方面，央行在 1 月和 3 月上调了 MLF 利率与公开市场利率，6 月以来央行通过加大公开市场投放和提前续作 MLF 维稳资金面。积极财政政策发力，上半年公共财政支出同比增长 15.8%，大于财政收入增速 6 个百分点。

股票市场走势分化明显，上证综指一季度在波动中上行，4 月调整后再度攀升，而创业板总体呈下跌趋势。从市场风格看，上半年业绩稳定、估值较低的大盘蓝筹，尤其以家电、白酒、银行等行业为代表的股票均上涨明显，而估值较高，同时业绩不达预期的小盘股则大幅下跌。中证养老指数走势与上证综指趋同，3 月底经历较大幅度下跌后，5 月中旬开始上涨。

上半年本基金投资严格遵守基金合同，紧密跟踪标的指数。

#### 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 0.801 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.03%，业绩比较基准收益率为 5.22%。

#### 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 年下半年海外经济总体仍在复苏进程中，欧元区经济复苏动能逐渐增强，预计年内欧央行货币政策也会迎来转向，在此之前预计美元维持弱势。中国经济增速下半年可能小幅回落，但由于出口持续回暖对经济构成支撑，部分前期滞涨的三线城市销售仍然较强，加上地方政府加大土地供给也支撑了房地产投资增速，经济的韧性仍然较强。下半年通胀预计将会继续回落，商品和房价后期会面临回落压力，劳动力市场预期也将由紧转松。

由于近期看不到资金的大规模流入，金融强监管和去杠杆仍将是未来一段时间政策基调，同时创业板上市公司业绩仍然面临较大压力，股票市场总体仍然呈现震荡分化行情。

下半年本基金将严格遵守基金合同，紧密跟踪标的指数，尽最大努力降低跟踪误差。

#### 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。

#### 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

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,898,827.58	11,101,594.08
结算备付金		27,219.03	30,149.85
存出保证金		59,658.15	55,391.42
交易性金融资产	6.4.7.2	118,070,006.99	127,328,371.33
其中：股票投资		118,070,006.99	127,328,371.33
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,198.53	4,480.21
应收股利		-	-
应收申购款		1,094.45	4,356.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		125,060,004.73	138,524,343.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2017年6月30日</b>	<b>2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		222.93	3,448,141.73
应付赎回款		297,796.60	7,244.13
应付管理人报酬		104,844.06	106,352.10
应付托管费		20,968.82	21,270.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	53,702.78	79,118.12
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	281,052.88	251,027.28
负债合计		758,588.07	3,913,153.78

<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	148,771,463.32	169,215,041.63
未分配利润	6.4.7.10	-24,470,046.66	-34,603,852.33
所有者权益合计		124,301,416.66	134,611,189.30
负债和所有者权益总计		125,060,004.73	138,524,343.08

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，养老基金份额净值人民币 0.801 元，养老 A 级的基金份额净值人民币 1.024 元，养老 B 级的基金份额净值人民币 0.578 元；基金份额总额为 155,178,292.87 份，其中养老基金份额为 110,229,552.87 份，养老 A 级基金份额为 22,474,370.00 份，养老 B 级基金份额为 22,474,370.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		7,626,780.60	-23,105,515.95
1.利息收入		64,063.20	96,692.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,063.20	96,692.79
债券利息收入		-	-
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）		-511,445.90	-9,759,973.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,252,437.40	-10,605,225.69
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	740,991.50	845,252.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,032,029.11	-13,565,624.31
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	42,134.19	123,388.95
<b>减：二、费用</b>		1,206,209.34	1,527,707.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	673,237.56	778,199.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,647.53	155,639.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	169,390.71	359,609.23
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	228,933.54	234,259.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,420,571.26	-24,633,223.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,420,571.26	-24,633,223.86

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

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）	169,215,041.63	-34,603,852.33	134,611,189.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,420,571.26	6,420,571.26
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）	-20,443,578.31	3,713,234.41	-16,730,343.90
其中：1.基金申购款	21,963,456.89	-4,465,525.04	17,497,931.85
2.基金赎回款	-42,407,035.20	8,178,759.45	-34,228,275.75
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）	148,771,463.32	-24,470,046.66	124,301,416.66
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）	156,295,948.20	-4,647,531.70	151,648,416.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,633,223.86	-24,633,223.86
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）	38,360,216.64	-8,446,615.58	29,913,601.06
其中：1.基金申购款	161,255,574.36	-32,597,284.91	128,658,289.45

2. 基金赎回款	-122,895,357.72	24,150,669.33	-98,744,688.39
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）	194,656,164.84	-37,727,371.14	156,928,793.70

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  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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金(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]763号文《关于准予国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金注册的批复》的核准,由国寿安保基金管理有限公司于2015年6月8日至2015年6月19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\_A05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6月26日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为276,524,524.25份基金份额。根据《基金合同》的约定,基金份额发售结束后,场外认购的全部份额将确认为国寿养老份额;场内认购的份额将按照1:1的比例自动分离为国寿养老A份额与国寿养老B份额。其中场内认购的基金份额(含募集期利息结转的份额)确认为105,708,524.00份,场外认购的基金份额(含募集期利息结转的份额)确认为170,816,000.25份。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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金的基金份额包括国寿养老份额、国寿养老A份额、国寿养老B份额。根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。国寿养老A份额与国寿养老B份额的配比始终保持1:1的比率不变。

每年的基金份额定期折算基准日，本基金将按照《基金合同》的规定对国寿养老 A 份额和国寿养老份额进行定期份额折算。基金份额折算基准日为每年 12 月 15 日（若该日为非工作日，则提前至该日之前的最后一个工作日）。定期份额折算后国寿养老 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前国寿养老 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为国寿养老份额的场内份额分配给 A 份额持有人。国寿养老份额持有人持有的每两份份额将按一份国寿养老 A 份额获得新增份额的分配，经过上述份额折算后，国寿养老份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

除以上定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当国寿养老份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上；当国寿养老 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下。当国寿养老份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额和国寿养老份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的比例为 1:1，份额折算后国寿养老 A 份额的基金份额参考净值、国寿养老 B 份额的基金份额参考净值和国寿养老份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当国寿养老 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额和国寿养老份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的比例为 1:1，份额折算后国寿养老份额的基金份额净值、国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证养老产业指数的成份股、备选成份股、其他股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、固定收益资产（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（含超短期融资券）、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（权证等）及法律法规或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）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证养老产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## 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 3 号《半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 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

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《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[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	6,898,827.58
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计:	6,898,827.58

#### 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	117,687,883.44	118,070,006.99	382,123.55
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	117,687,883.44	118,070,006.99	382,123.55

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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	3,159.53
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	12.20
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	26.80
合计	3,198.53

#### 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	53,702.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	53,702.78

#### 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	1,119.34
预提费用	229,933.54
应付指数使用费	50,000.00



合计	281,052.88
----	------------

#### 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	176,507,923.20	169,215,041.63
本期申购	22,905,595.45	21,963,456.89
本期赎回(以“-”号填列)	-44,235,225.78	-42,407,035.20
- 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	155,178,292.87	148,771,463.32

(1) 根据《基金合同》的约定，基金份额发售结束后，场外认购的全部份额将确认为国寿养老份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例自动分离为国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额。折算拆分后，于基金合同生效日，本基金份额总额 276,524,524.25 份；

(2) 根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回国寿养老份额，国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的情况。

#### 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	-18,018,691.49	-16,585,160.84	-34,603,852.33
本期利润	-1,611,457.85	8,032,029.11	6,420,571.26
本期基金份额交易产生的变动数	2,422,593.62	1,290,640.79	3,713,234.41
其中：基金申购款	-2,353,829.26	-2,111,695.78	-4,465,525.04

基金赎回款	4,776,422.88	3,402,336.57	8,178,759.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,207,555.72	-7,262,490.94	-24,470,046.66

#### 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	62,566.98
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	906.81
其他	589.41
合计	64,063.20

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 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	69,144,192.73
减：卖出股票成本总额	70,396,630.13
买卖股票差价收入	-1,252,437.40

#### 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投资收益。

##### 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投资产生的收益/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收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金于本报告期间无买卖权证产生的收益/损失。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

本基金于本报告期间无买卖其他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	740,991.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	740,991.50

**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	8,032,029.11
——股票投资	8,032,029.11
——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	8,032,029.11

**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	42,134.19
其他	-
合计	42,134.19

#### 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	169,390.71
银行间市场交易费用	-
合计	169,390.71

#### 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	74,385.57
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	228,933.54

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 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”）	基金管理人、直销机构
招商证券股份有限公司（简称“招商证券”）	基金托管人
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券	-	-	99,587,842.55	34.98%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	72,828.57	34.98%	72,828.57	78.46%

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 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	673,237.56
其中：支付销售机构的客户维护费	41,105.21	40,035.85

注：基金管理费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 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	134,647.53	155,639.89
----------------	------------	------------

注：基金托管费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

国寿安保中证养老产业指数分级				
关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 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
集团公司	93,885,815.24	85.17%	93,885,815.24	87.71%

##### 6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 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
招商证券	6,898,827.58	62,566.98	9,096,505.64	96,692.79

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.6 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未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 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。

#### 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

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。

##### 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
002399	海普瑞	2017 年 6 月 29 日	公告重大事项	20.23	-	-	89,382	1,629,272.10	1,808,197.86	-
000100	TCL 集团	2017 年 6 月 2 日	公告重大事项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	479,200	1,890,242.47	1,643,656.00	-
002252	上海莱士	2017 年 6 月 21 日	公告重大事项	20.24	-	-	77,515	1,717,587.50	1,568,903.60	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	公告重大事项	7.68	-	-	200,500	1,839,775.20	1,539,840.00	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	公告重大事项	10.57	-	-	132,020	1,618,115.29	1,395,451.40	-
300413	快乐购	2017 年 4 月 5 日	公告重大事项	20.29	-	-	66,348	1,880,005.15	1,346,200.92	-
300267	尔康制药	2017 年 6 月 16 日	公告重大事项	11.46	-	-	113,708	1,653,364.83	1,303,093.68	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	公告重大事项	30.68	-	-	42,000	1,772,439.71	1,288,560.00	-
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	公告重大事项	24.93	-	-	32,600	1,149,689.81	812,718.00	-



### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 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；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未持有债券投资，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	6,898,827.58	-	-	-	6,898,827.58
结算备付金	27,219.03	-	-	-	27,219.03
存出保证金	59,658.15	-	-	-	59,658.15
交易性金融资产	-	-	-	-118,070,006.99	118,070,006.99
应收利息	-	-	-	3,198.53	3,198.53
应收申购款	-	-	-	1,094.45	1,094.45
资产总计	6,985,704.76	-	-	-118,074,299.97	125,060,004.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	222.93	222.93
应付赎回款	-	-	-	297,796.60	297,796.60

应付管理人报酬	-	-	-	104,844.06	104,844.06
应付托管费	-	-	-	20,968.82	20,968.82
应付交易费用	-	-	-	53,702.78	53,702.78
其他负债	-	-	-	281,052.88	281,052.88
负债总计	-	-	-	758,588.07	758,588.07
利率敏感度缺口	6,985,704.76	-	-	-117,315,711.90	124,301,416.66
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	11,101,594.08	-	-	-	11,101,594.08
结算备付金	30,149.85	-	-	-	30,149.85
存出保证金	55,391.42	-	-	-	55,391.42
交易性金融资产	-	-	-	-127,328,371.33	127,328,371.33
应收利息	-	-	-	4,480.21	4,480.21
应收申购款	-	-	-	4,356.19	4,356.19
资产总计	11,187,135.35	-	-	-127,337,207.73	138,524,343.08
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,448,141.73	3,448,141.73
应付赎回款	-	-	-	7,244.13	7,244.13
应付管理人报酬	-	-	-	106,352.10	106,352.10
应付托管费	-	-	-	21,270.42	21,270.42
应付交易费用	-	-	-	79,118.12	79,118.12
其他负债	-	-	-	251,027.28	251,027.28
负债总计	-	-	-	3,913,153.78	3,913,153.78
利率敏感度缺口	11,187,135.35	-	-	-123,424,053.95	134,611,189.30

#### 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于本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。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于中证养老产业指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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	118,070,006.99	94.99	127,328,371.33	94.59
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	118,070,006.99	94.99	127,328,371.33	94.59

##### 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 系数是根据本报告期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%	6,062,976.01	6,958,254.62
	-5%	-6,062,976.01	-6,958,254.62

#### 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 105,363,385.53 元，属于第二层次的余额为人民币 11,418,061.46 元，属于第三层次的余额为人民币 1,288,560.00 元。

##### (2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。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转入第三层次公允价值金额为 1,288,560.00 元。

##### 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	118,070,006.99	94.41
	其中：股票	118,070,006.99	94.41
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	6,926,046.61	5.54
7	其他各项资产	63,951.13	0.05
8	合计	125,060,004.73	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	52,650,859.74	42.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,809,268.68	7.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,409,118.70	1.13

I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,635,602.79	16.60
J	金融业	8,783,755.05	7.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,815,485.32	2.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,934,848.00	2.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,394,589.00	1.12
Q	卫生和社会工作	3,065,756.62	2.47
R	文化、体育和娱乐业	15,570,723.09	12.53
S	综合	-	-
	合计	118,070,006.99	94.99

### 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	601601	中国太保	59,711	2,022,411.57	1.63
2	601318	中国平安	39,468	1,958,007.48	1.58
3	601336	新华保险	36,000	1,850,400.00	1.49
4	002399	海普瑞	89,382	1,808,197.86	1.45
5	000100	TCL 集团	479,200	1,643,656.00	1.32
6	600373	中文传媒	69,700	1,638,647.00	1.32
7	600315	上海家化	49,400	1,603,030.00	1.29
8	000069	华侨城 A	158,300	1,592,498.00	1.28
9	600715	文投控股	69,800	1,574,688.00	1.27
10	002252	上海莱士	77,515	1,568,903.60	1.26
11	002044	美年健康	91,900	1,562,300.00	1.26
12	300003	乐普医疗	70,302	1,554,377.22	1.25

13	000627	天茂集团	191,700	1,548,936.00	1.25
14	600887	伊利股份	71,700	1,548,003.00	1.25
15	601607	上海医药	53,599	1,547,939.12	1.25
16	002294	信立泰	43,348	1,545,789.68	1.24
17	002426	胜利精密	200,500	1,539,840.00	1.24
18	000839	中信国安	153,950	1,537,960.50	1.24
19	000963	华东医药	30,930	1,537,221.00	1.24
20	600436	片仔癀	25,000	1,526,000.00	1.23
21	300015	爱尔眼科	64,637	1,503,456.62	1.21
22	000423	东阿阿胶	20,903	1,502,716.67	1.21
23	600867	通化东宝	82,248	1,500,203.52	1.21
24	002292	奥飞娱乐	88,700	1,499,030.00	1.21
25	002411	必康股份	51,800	1,498,056.00	1.21
26	600085	同仁堂	42,800	1,496,288.00	1.20
27	002558	世纪游轮	32,120	1,484,586.40	1.19
28	600998	九州通	68,794	1,483,198.64	1.19
29	002424	贵州百灵	78,500	1,480,510.00	1.19
30	601801	皖新传媒	106,746	1,475,229.72	1.19
31	000999	华润三九	46,296	1,469,898.00	1.18
32	603716	塞力斯	15,100	1,464,549.00	1.18
33	002174	游族网络	46,100	1,464,136.00	1.18
34	600637	东方明珠	67,503	1,462,790.01	1.18
35	600566	济川药业	38,413	1,460,846.39	1.18
36	300017	网宿科技	120,837	1,458,502.59	1.17
37	002517	恺英网络	41,400	1,456,866.00	1.17
38	600804	鹏博士	81,883	1,453,423.25	1.17
39	000538	云南白药	15,432	1,448,293.20	1.17
40	600535	天士力	34,837	1,447,128.98	1.16



41	601098	中南传媒	77,400	1,442,736.00	1.16
42	000623	吉林敖东	62,930	1,440,467.70	1.16
43	002555	三七互娱	56,090	1,434,221.30	1.15
44	600332	白云山	49,300	1,431,672.00	1.15
45	601933	永辉超市	202,000	1,430,160.00	1.15
46	600521	华海药业	67,700	1,424,408.00	1.15
47	601888	中国国旅	47,038	1,417,725.32	1.14
48	000156	华数传媒	94,851	1,414,228.41	1.14
49	002624	完美世界	41,100	1,409,730.00	1.13
50	600276	恒瑞医药	27,856	1,409,235.04	1.13
51	600754	锦江股份	51,997	1,409,118.70	1.13
52	600079	人福医药	71,800	1,408,716.00	1.13
53	002007	华兰生物	38,538	1,406,637.00	1.13
54	000416	民生控股	175,500	1,404,000.00	1.13
55	300558	贝达药业	23,500	1,401,540.00	1.13
56	000587	金洲慈航	93,900	1,399,110.00	1.13
57	300178	腾邦国际	109,200	1,397,760.00	1.12
58	002508	老板电器	32,140	1,397,447.20	1.12
59	600959	江苏有线	132,020	1,395,451.40	1.12
60	300027	华谊兄弟	172,395	1,394,675.55	1.12
61	603377	东方时尚	37,100	1,394,589.00	1.12
62	600518	康美药业	63,930	1,389,838.20	1.12
63	601928	凤凰传媒	142,000	1,385,920.00	1.11
64	300122	智飞生物	72,300	1,381,653.00	1.11
65	300418	昆仑万维	60,410	1,381,576.70	1.11
66	300251	光线传媒	167,006	1,367,779.14	1.10
67	603866	桃李面包	38,300	1,362,714.00	1.10
68	000848	承德露露	135,110	1,348,397.80	1.08

69	300413	快乐购	66,348	1,346,200.92	1.08
70	300059	东方财富	111,696	1,342,585.92	1.08
71	600054	黄山旅游	78,500	1,342,350.00	1.08
72	600977	中国电影	71,700	1,342,224.00	1.08
73	603858	步长制药	18,700	1,339,668.00	1.08
74	600196	复星医药	43,200	1,338,768.00	1.08
75	002094	青岛金王	62,200	1,326,726.00	1.07
76	300144	宋城演艺	63,321	1,321,509.27	1.06
77	300267	尔康制药	113,708	1,303,093.68	1.05
78	300104	乐视网	42,000	1,288,560.00	1.04
79	300315	掌趣科技	153,492	1,252,494.72	1.01
80	002739	万达院线	23,800	1,213,086.00	0.98
81	000503	海虹控股	32,600	812,718.00	0.65

#### 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	002558	世纪游轮	1,680,775.00	1.25
2	002624	完美世界	1,621,351.00	1.20
3	002044	美年健康	1,601,715.00	1.19
4	600566	济川药业	1,571,978.17	1.17
5	002411	必康股份	1,569,836.10	1.17
6	600521	华海药业	1,537,261.00	1.14
7	000416	民生控股	1,526,592.00	1.13
8	600977	中国电影	1,513,382.14	1.12
9	300558	贝达药业	1,499,309.00	1.11
10	603866	桃李面包	1,494,044.39	1.11

11	600054	黄山旅游	1,492,250.00	1.11
12	603716	塞力斯	1,486,297.00	1.10
13	603858	步长制药	1,478,949.00	1.10
14	300017	网宿科技	965,272.00	0.72
15	300104	乐视网	938,196.00	0.70
16	002292	奥飞娱乐	856,825.00	0.64
17	002094	青岛金王	836,034.00	0.62
18	300027	华谊兄弟	755,792.50	0.56
19	300178	腾邦国际	679,678.00	0.50
20	601801	皖新传媒	659,423.00	0.49

#### 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	002195	二三四五	1,953,481.20	1.45
2	300113	顺网科技	1,797,607.07	1.34
3	300133	华策影视	1,751,654.84	1.30
4	002422	科伦药业	1,743,878.74	1.30
5	300146	汤臣倍健	1,741,958.40	1.29
6	002462	嘉事堂	1,727,932.80	1.28
7	600037	歌华有线	1,704,548.50	1.27
8	002354	天神娱乐	1,690,717.80	1.26
9	300383	光环新网	1,654,261.00	1.23
10	300244	迪安诊断	1,627,629.00	1.21
11	002508	老板电器	1,620,591.00	1.20
12	300023	宝德股份	1,617,401.00	1.20
13	601933	永辉超市	1,569,144.00	1.17
14	000917	电广传媒	1,508,736.00	1.12

15	600196	复星医药	1,499,536.60	1.11
16	601318	中国平安	1,491,451.02	1.11
17	002555	三七互娱	1,373,362.00	1.02
18	601336	新华保险	1,288,207.00	0.96
19	000538	云南白药	1,245,966.00	0.93
20	601888	中国国旅	1,195,836.56	0.89

#### 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	53,106,236.68
卖出股票收入（成交）总额	69,144,192.73

#### 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 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。

#### 7.8 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。

#### 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投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 本基金本报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。**

**7.12.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的股票库。**

### 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	59,658.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,198.53
5	应收申购款	1,094.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,951.13

### 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	002399	海普瑞	1,808,197.86	1.45	公告重大事项
2	000100	TCL 集团	1,643,656.00	1.32	公告重大事项
3	002252	上海莱士	1,568,903.60	1.26	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

份额单位：份

份额级别	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
国寿安保中证养老产业指数分级 A	273	82,323.70	7,504,458.00	33.39%	14,969,912.00	66.61%
国寿安保中证养老产业指数分级 B	1,418	15,849.34	2,710.00	0.01%	22,471,660.00	99.99%
国寿安保中证养老产业指数分级	1,369	80,518.30	94,032,428.24	85.31%	16,197,124.63	14.69%
合计	3,060	50,711.86	101,539,596.24	65.43%	53,638,696.63	34.57%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

国寿安保中证养老产业指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李怡名	11,078,826.00	49.30%
2	海通资管—上海银行—海通赢家系列—月月赢集合资产管理计划	4,759,700.00	21.18%
3	黄松友	2,366,500.00	10.53%

4	中融国际信托有限公司-中融-融金 添利单一资金信托	1,969,000.00	8.76%
5	海通资管-民生-海通年年升集合 资产管理计划	300,000.00	1.33%
6	陶介清	200,000.00	0.89%
7	中国对外经济贸易信托有限公司- 外贸信托-千象 CTA 私募证券	180,000.00	0.80%
8	民生通惠资产-中信银行-民生通 惠聚利 3 号资产管理产品	160,600.00	0.71%
9	郑志坤	119,656.00	0.53%
10	张海江	100,000.00	0.44%

## 国寿安保中证养老产业指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	付晓萍	3,116,300.00	13.87%
2	辛文忠	354,143.00	1.58%
3	吴嫣	329,913.00	1.47%
4	冷才华	303,100.00	1.35%
5	陈霖	293,200.00	1.30%
6	万宏	290,000.00	1.29%
7	董家祥	280,000.00	1.25%
8	张晔雯	275,400.00	1.23%
9	郑芝菲	270,000.00	1.20%
10	董正皓	270,000.00	1.20%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

本报告期末本基金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、基金投资和研发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

项目	国寿安保中证养老产业指数分级 A	国寿安保中证养老产业指数分级 B	国寿安保中证养老产业指数分级
基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日） 基金份额总额	52,854,262.00	52,854,262.00	170,816,000.25
本报告期期初基金份额总额	34,734,286.00	34,734,286.00	107,039,351.20
本报告期基金总申购份额	-	-	22,905,595.45
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	44,235,225.78
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-12,259,916.00	-12,259,916.00	24,519,832.00
本报告期期末基金份额总额	22,474,370.00	22,474,370.00	110,229,552.87

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## § 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****10.7.1 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	
银河证券	2	122,250,429.41	100.00%	89,401.89	100.00%	-
招商证券	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》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本公司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。

**10.7.2 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
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

**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	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2016 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
2	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2017 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 2 月 9 日
3	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2016 年年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 3 月 28 日
4	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 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
5	关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金风险提示公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 4 月 25 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	1	20170101-20170630	93,885,815.24	-	-	93,885,815.24	60.50%

个人	-	-	-	-	-	-
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养老产业指数分级证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保中证养老产业指数分级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养老产业指数分级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](http://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