

国寿安保中证 500 交易型开放式
指数证券投资基金
2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 27 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 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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 2017 年 01 月 01 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
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.....	10
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.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
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.....	40
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.....	55
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.....	55
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.....	55

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	55
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	57
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	57
§10 开放式基金份额变动.....	58
§ 11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
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 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
12.1 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	61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§13 备查文件目录.....	61
13.1 备查文件目录	61
13.2 存放地点	62
13.3 查阅方式	62

§ 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	172,318,687.00 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	贺倩
	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	2017 年	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	-12,215,154.18	-126,481,756.24	-77,812,233.46
本期利润	5,702,879.68	-94,764,809.74	-159,940,634.35
加权平均基金份额本期利润	0.0307	-0.3473	-0.4618
本期加权平均净值利润率	2.33%	-27.35%	-31.86%
本期基金份额净值增长率	1.86%	-16.79%	-27.71%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-144,112,337.65	-175,819,876.25	-204,834,675.21
期末可供分配基金份额利润	-0.8363	-0.8605	-0.5984
期末基金资产净值	228,040,844.54	265,443,058.59	534,464,068.10
期末基金份额净值	1.3234	1.2992	1.5613
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-38.72%	-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。

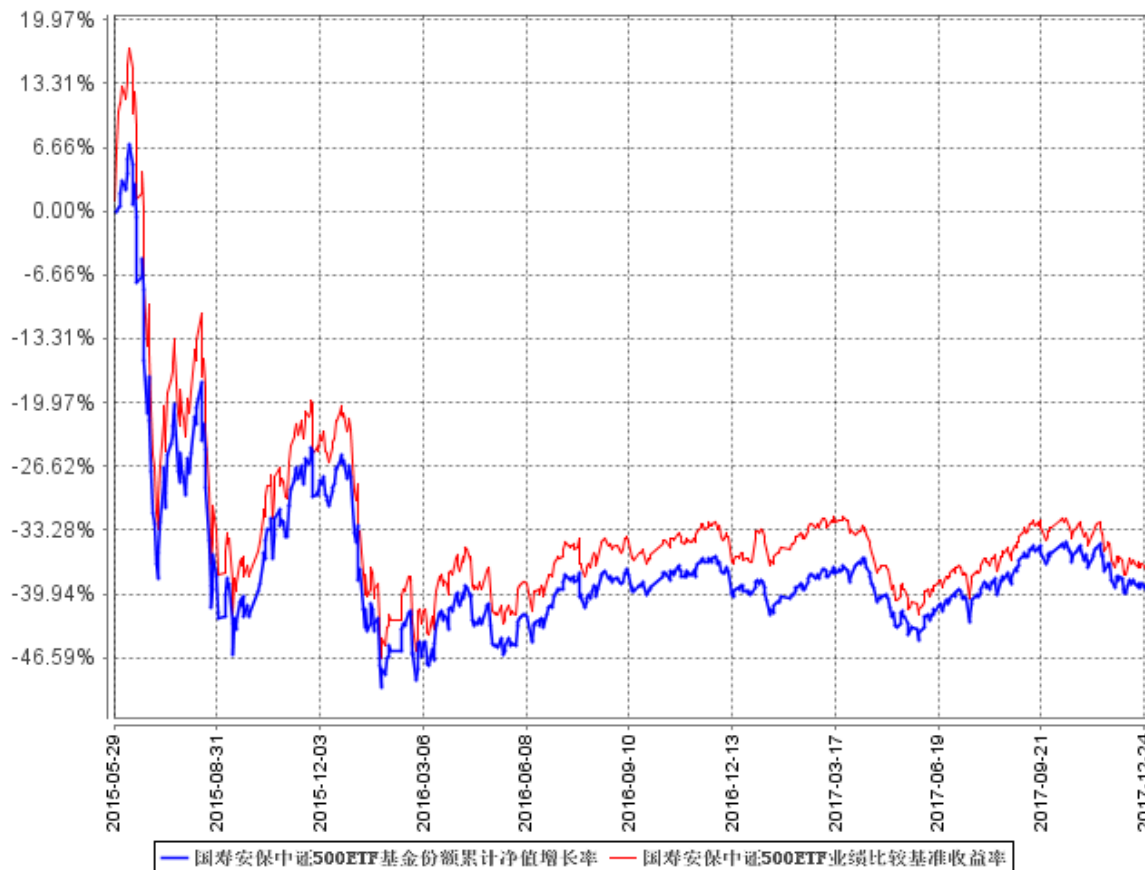
3.2 基金净值表现

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	-4.84%	0.96%	-5.34%	0.98%	0.50%	-0.02%
过去六个月	2.71%	0.94%	1.84%	0.96%	0.87%	-0.02%
过去一年	1.86%	0.91%	-0.20%	0.94%	2.06%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-38.72%	2.00%	-36.66%	2.06%	-2.06%	-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

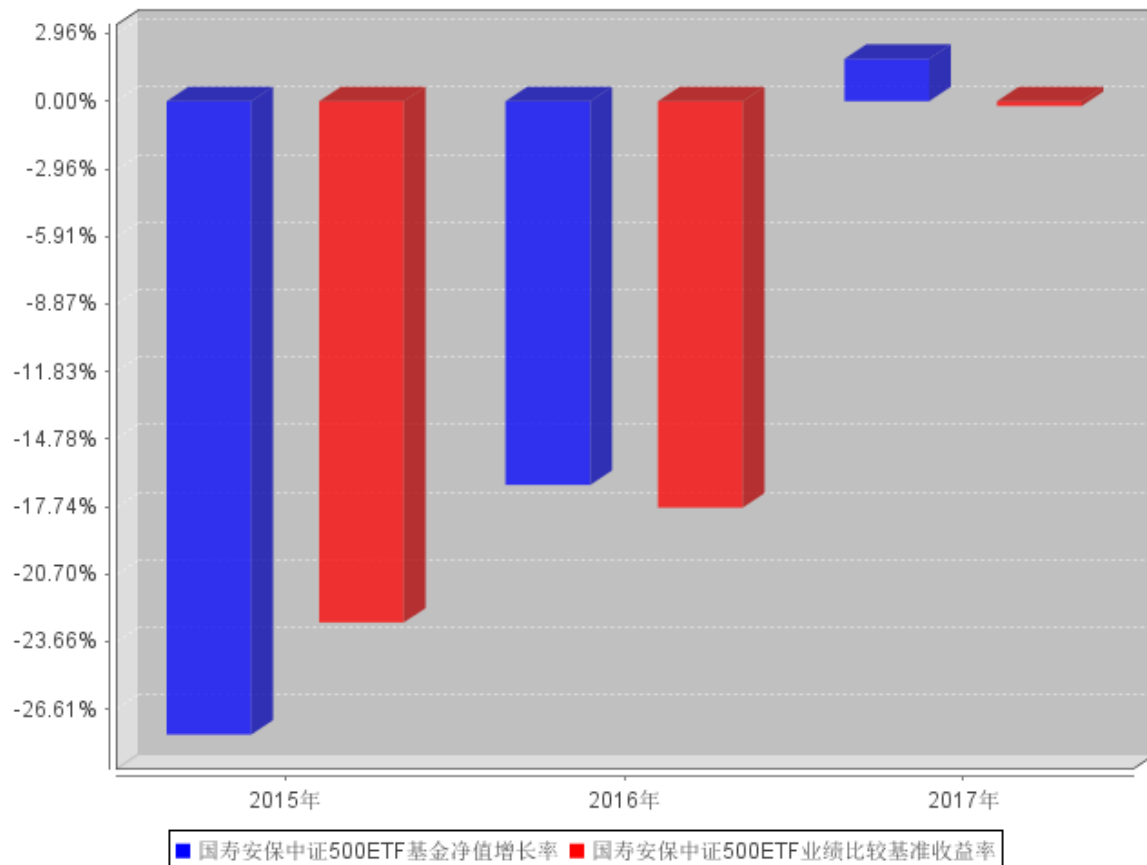
国寿安保中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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，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 12 月 31 日，公司共管理 40 只公募基金及部分特定资产管理计划，公司管理资产总规模为 1,833.22 亿元，其中公募基金管理规模为 1,397.38 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或本基金管理人对外披露的任职日期。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。

4.3.3 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 1.3234 元，累计份额净值为 0.6128 元。报告期内净值增长率为 1.86%，同期业绩基准涨幅为 -0.20%。

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 2018 年，国内宏观经济稳定，供给侧改革继续推进，宏观去杠杆仍然是大的基调，有利于控制系统性风险。海外市场继续弱复苏态势，为我国经济发展创造了

有利的环境。2018 年房地产投资、制造业投资和消费保持稳定的可能性较大，基建投资和出口有所放缓。股票市场经过 2017 年极端分化的白马行情后，创蓝筹股票可能迎来新的投资机会。政策层面，十九大后改革将乘势而上，加速推动消费升级和产业结构调整，国企改革、一带一路、5G 等主题性投资机会将不断涌现。

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督察长担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人和研究部负责人组成，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。

4.8 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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(2018)审字第 61090605_A08 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
审计意见	<p>我们审计了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的</p>

	<p>情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
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)
注册会计师的姓名	辜虹 吴军
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	2018 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: 2017 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,624,428.57	2,218,971.22
结算备付金		22,094.94	-
存出保证金		8,586.75	99,907.12
交易性金融资产	7.4.7.2	224,035,044.53	263,627,678.04
其中: 股票投资		224,035,044.53	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,020.22	507.56
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		228,691,175.01	265,947,063.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31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	7.4.7.3	-	-
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		96,578.53	114,935.19
应付托管费		19,315.71	22,987.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	54,436.23	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	7.4.7.8	480,000.00	300,000.00
负债合计		650,330.47	504,005.35
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	372,153,182.19	441,262,934.84
未分配利润	7.4.7.10	-144,112,337.65	-175,819,876.25
所有者权益合计		228,040,844.54	265,443,058.59
负债和所有者权益总计		228,691,175.01	265,947,063.94

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3234 元，基金份额总额 172,318,687 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		8,048,646.84	-91,367,428.24
1.利息收入		22,074.71	37,907.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	22,074.71	37,888.62
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,235,664.79	-123,909,173.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-12,111,131.18	-126,431,352.18
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	1,875,466.39	2,511,598.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	17,918,033.86	31,716,946.50
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	344,203.06	786,891.64
减：二、费用		2,345,767.16	3,397,381.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,228,414.91	1,737,443.30
2. 托管费	7.4.10.2.2	245,683.03	347,488.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	297,425.35	796,222.37
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	574,243.87	516,227.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,702,879.68	-94,764,809.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,702,879.68	-94,764,809.74

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	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）	-	5,702,879.68	5,702,879.68
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）	-69,109,752.65	26,004,658.92	-43,105,093.73
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	-146,858,224.32	55,348,835.95	-91,509,388.37
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）	372,153,182.19	-144,112,337.65	228,040,844.54
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>左季庆</u>	<u>左季庆</u>	<u>韩占锋</u>
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 日向社会公开发行人募集，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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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 增值税

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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣

等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	4,624,428.57	2,218,971.22
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	4,624,428.57	2,218,971.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	256,528,465.06	224,035,044.53	-32,493,420.53
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	256,528,465.06	224,035,044.53	-32,493,420.53
项目	上年度末 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	

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,004.93	458.06
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	11.00	0.00
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	4.29	49.50
合计	1,020.22	507.56

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	54,436.23	57,188.73
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	54,436.23	57,188.73

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 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	430,000.00	250,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	480,000.00	300,000.00

7.4.7.9 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 12 月 31 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)	-68,000,000.00	-146,858,224.32
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	172,318,687.00	372,153,182.19

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	-145,407,131.09	-30,412,745.16	-175,819,876.25
本期利润	-12,215,154.18	17,918,033.86	5,702,879.68
本期基金份额交易产生的变动数	23,869,577.93	2,135,080.99	26,004,658.92
其中：基金申购款	-26,984,684.85	-2,359,492.18	-29,344,177.03
基金赎回款	50,854,262.78	4,494,573.17	55,348,835.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-133,752,707.34	-10,359,630.31	-144,112,337.65

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	20,589.10
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	1,125.31	3,382.67
其他	360.30	1,671.57
合计	22,074.71	37,888.62

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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,185,651.78	-76,237,569.41
股票投资收益——赎回差价收入	-5,925,479.40	-50,193,782.77
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-12,111,131.18	-126,431,352.18

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 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出股票成交总额	117,018,625.40	311,559,843.94
减：卖出股票成本总额	123,204,277.18	387,797,413.35
买卖股票差价收入	-6,185,651.78	-76,237,569.41

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 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
赎回基金份额对价总额	91,509,388.37	317,441,005.32
减：现金支付赎回款总额	48,174,000.37	168,441,261.32
减：赎回股票成本总额	49,260,867.40	199,193,526.77
赎回差价收入	-5,925,479.40	-50,193,782.77

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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
股票投资产生的股利收益	1,875,466.39	2,511,598.78
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,875,466.39	2,511,598.78

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	17,918,033.86	31,716,946.50
——股票投资	17,918,033.86	31,716,946.50
——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	17,918,033.86	31,716,946.50

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	344,203.06	786,891.64
其他	-	-
合计	344,203.06	786,891.64

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	297,425.35	796,222.37
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	297,425.35	796,222.37

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
----	---	--

审计费用	50,000.00	70,000.00
信息披露费	260,000.00	180,000.00
银行费用	4,243.87	6,227.17
指数使用费	200,000.00	200,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
其他	-	-
合计	574,243.87	516,227.17

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、注册登记机构、直销机构
农业银行	基金托管人、销售机构
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”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	1, 228, 414. 91	1, 737, 443. 30
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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	245, 683. 03	347, 488. 66

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

本基金的除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	4,624,428.57	20,589.10	2,218,971.22	32,834.38

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（2017 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	IPO 未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

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
600525	长园集团	2017 年 12 月 25 日	公告重大事项	15.79	2018 年 1 月 10 日	17.30	69,980	1,236,278.20	1,104,984.20	-
300156	神雾环保	2017 年 7 月 17 日	公告重大事项	24.16	2018 年 1 月 17 日	21.74	35,700	961,087.00	862,512.00	-
002366	台海核电	2017 年 12 月 6 日	公告重大事项	26.45	-	-	28,700	759,543.96	759,115.00	-
002168	深圳惠程	2017 年 12 月 19 日	公告重大事项	13.76	-	-	55,100	806,049.52	758,176.00	-
000930	中粮生化	2017 年 10 月 24 日	公告重大事项	13.34	-	-	54,200	774,880.29	723,028.00	-
300383	光环新网	2017 年 11 月 7 日	公告重大事项	13.19	2018 年 3 月 19 日	14.51	48,500	613,116.92	639,715.00	-
000547	航天发展	2017 年 10 月 30 日	公告重大事项	10.83	-	-	56,300	1,384,642.26	609,729.00	-
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	公告重大事项	12.89	-	-	44,700	777,329.07	576,183.00	-
600614	鹏起科技	2017 年 12 月 26 日	公告重大事项	10.16	-	-	56,200	630,889.72	570,992.00	-
000979	中弘股份	2017 年 9 月 7 日	公告重大事项	1.94	2018 年 2 月 14 日	1.75	288,960	690,861.88	560,582.40	-

002512	达华智能	2017 年 12 月 6 日	股票异常波动自查	18.07	2018 年 3 月 6 日	16.26	30,100	550,852.30	543,907.00	-
000006	深振业 A	2017 年 9 月 11 日	公告重大事项	9.85	2018 年 3 月 8 日	8.87	54,200	577,938.67	533,870.00	-
000592	平潭发展	2017 年 8 月 9 日	违反企业会计准则及制度	5.75	2018 年 1 月 29 日	5.70	90,700	875,117.05	521,525.00	-
000401	冀东水泥	2017 年 11 月 21 日	公告重大事项	13.79	2018 年 1 月 15 日	15.17	37,600	512,867.97	518,504.00	-
002745	木林森	2017 年 12 月 28 日	公告重大事项	45.50	2018 年 1 月 5 日	46.50	11,200	523,854.00	509,600.00	-
002004	华邦健康	2017 年 12 月 14 日	公告重大事项	6.73	2018 年 3 月 14 日	7.30	75,650	857,083.59	509,124.50	-
000031	中粮地产	2017 年 7 月 24 日	公告重大事项	8.00	-	-	63,300	715,869.98	506,400.00	-
600664	哈药股份	2017 年 9 月 28 日	公告重大事项	5.81	2018 年 2 月 27 日	6.00	83,426	775,525.86	484,705.06	-
600645	中源协和	2017 年 10 月 9 日	公告重大事项	28.40	2018 年 1 月 19 日	25.56	16,900	726,129.95	479,960.00	-
000926	福星股份	2017 年 12 月 26 日	公告重大事项	10.89	2018 年 1 月 11 日	12.30	40,400	519,400.03	439,956.00	-
000939	凯迪生态	2017 年 11 月 16 日	公告重大事项	4.99	-	-	87,700	567,595.64	437,623.00	-
300159	新研股份	2017 年 11 月 23 日	公告重大事项	10.40	2018 年 3 月 22 日	11.27	41,600	681,923.86	432,640.00	-
000806	银河生物	2017 年 7 月 18 日	公告重大事项	10.76	2018 年 1 月 18 日	10.01	38,800	641,780.22	417,488.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	公告重大事项	12.50	2018 年 3 月 21 日	11.88	33,300	809,235.39	416,250.00	-
300116	坚瑞消防	2017 年 12 月 18 日	公告重大事项	7.62	-	-	51,600	486,204.93	393,192.00	-
000156	华数传媒	2017 年 12 月 26 日	公告重大事项	11.40	-	-	30,400	395,134.74	346,560.00	-
600187	国中水务	2017 年 11 月 9 日	公告重大事项	4.68	2018 年 3 月 20 日	4.21	72,200	471,474.42	337,896.00	-
300134	大富科技	2017 年 12 月 18 日	公告重大事项	16.45	2018 年 3 月 19 日	14.81	20,436	699,086.11	336,172.20	-
002122	天马股份	2017 年 12 月 19 日	公告重大事项	8.49	-	-	37,900	352,214.13	321,771.00	-
002358	森源电气	2017 年 12 月 7 日	公告重大事项	14.86	2018 年 3 月 7 日	15.05	20,600	417,419.28	306,116.00	-
000766	通化金马	2017 年 11 月 24 日	公告重大事项	13.60	-	-	21,600	370,008.00	293,760.00	-
300010	立思辰	2017 年 11 月 17 日	公告重大事项	11.17	2018 年 2 月 22 日	10.05	24,300	468,169.29	271,431.00	-
002345	潮宏基	2017 年 12 月 20 日	公告重大事项	10.75	-	-	24,100	283,190.96	259,075.00	-
300032	金龙机电	2017 年 11 月 27 日	公告重大事项	13.89	-	-	18,100	320,649.79	251,409.00	-
002344	海宁皮城	2017 年 11 月 1 日	公告重大事项	7.93	2018 年 1 月 31 日	7.44	28,900	376,601.16	229,177.00	-
300730	科创信息	2017 年 12 月 25 日	公告重大事项	41.55	2018 年 1 月 2 日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	公告重大事项	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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。

7.4.12.3.1 交易所市场债券正回购

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管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动

性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），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。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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 2017 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	4,624,428.57	-	-	-	4,624,428.57
结算备付金	22,094.94	-	-	-	22,094.94
存出保证金	8,586.75	-	-	-	8,586.75

交易性金融资产	-	-	-	224,035,044.53	224,035,044.53
应收利息	-	-	-	1,020.22	1,020.22
资产总计	4,655,110.26	-	-	224,036,064.75	228,691,175.01
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	96,578.53	96,578.53
应付托管费	-	-	-	19,315.71	19,315.71
应付交易费用	-	-	-	54,436.23	54,436.23
其他负债	-	-	-	480,000.00	480,000.00
负债总计	-	-	-	650,330.47	650,330.47
利率敏感度缺口	4,655,110.26	-	-	223,385,734.28	228,040,844.54
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

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 2017 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 2017 年 12 月 31 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	224,035,044.53	98.24	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	224,035,044.53	98.24	263,627,678.04	99.32

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 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	11,219,846.58	13,034,855.21
	-5%	-11,219,846.58	-13,034,855.21

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 2017 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 206,688,101.91 元（上年度末：

242,920,691.34 元),属于第二层次的余额为人民币 17,346,942.62 元(上年度末:20,706,986.70 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

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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 2018 年 3 月 26 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	224,035,044.53	97.96
	其中:股票	224,035,044.53	97.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,646,523.51	2.03
8	其他各项资产	9,606.97	0.00
9	合计	228,691,175.01	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	3,775,575.10	1.66
B	采矿业	8,030,279.76	3.52
C	制造业	133,428,359.07	58.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,052,373.40	3.09
E	建筑业	5,073,148.91	2.22
F	批发和零售业	11,850,523.60	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	7,216,763.17	3.16
H	住宿和餐饮业	277,694.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,387,204.60	8.06
J	金融业	4,156,258.00	1.82
K	房地产业	13,328,124.95	5.84
L	租赁和商务服务业	3,753,479.07	1.65
M	科学研究和技术服务业	479,960.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	2,478,169.50	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	267,866.00	0.12
Q	卫生和社会工作	412,877.60	0.18
R	文化、体育和娱乐业	2,926,767.80	1.28
S	综合	1,139,620.00	0.50
	合计	224,035,044.53	98.24

8.2.2 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港股通股票。

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	600516	方大炭素	56,900	1,643,272.00	0.72
2	600176	中国巨石	92,968	1,514,448.72	0.66
3	600201	生物股份	47,680	1,513,363.20	0.66
4	002405	四维图新	54,400	1,435,616.00	0.63
5	000661	长春高新	7,230	1,323,090.00	0.58
6	002422	科伦药业	45,800	1,140,420.00	0.50
7	002271	东方雨虹	28,100	1,122,876.00	0.49
8	600525	长园集团	69,980	1,104,984.20	0.48

9	002001	新和成	29,000	1,103,740.00	0.48
10	600584	长电科技	50,600	1,079,298.00	0.47
11	000786	北新建材	47,500	1,068,750.00	0.47
12	000998	隆平高科	40,090	1,031,114.80	0.45
13	002340	格林美	141,878	1,020,102.82	0.45
14	300274	阳光电源	53,820	1,010,201.40	0.44
15	600521	华海药业	33,290	1,002,694.80	0.44
16	600438	通威股份	82,400	997,864.00	0.44
17	600426	华鲁恒升	60,275	959,578.00	0.42
18	603019	中科曙光	23,800	957,712.00	0.42
19	002049	紫光国芯	19,300	926,207.00	0.41
20	600315	上海家化	25,100	925,939.00	0.41
21	000039	中集集团	40,300	920,855.00	0.40
22	002092	中泰化学	68,402	910,430.62	0.40
23	600079	人福医药	50,320	897,708.80	0.39
24	300266	兴源环境	33,200	896,400.00	0.39
25	000050	深天马 A	44,700	881,037.00	0.39
26	000830	鲁西化工	54,500	867,640.00	0.38
27	300156	神雾环保	35,700	862,512.00	0.38
28	002583	海能达	46,300	857,013.00	0.38
29	600298	安琪酵母	26,150	855,628.00	0.38
30	600642	申能股份	145,000	849,700.00	0.37
31	600256	广汇能源	166,300	841,478.00	0.37
32	601168	西部矿业	101,266	830,381.20	0.36
33	002050	三花股份	45,100	827,134.00	0.36
34	002179	中航光电	20,998	826,901.24	0.36
35	000009	中国宝安	114,000	824,220.00	0.36
36	600291	西水股份	34,900	820,848.00	0.36
37	600392	盛和资源	43,050	817,950.00	0.36
38	000977	浪潮信息	41,000	815,080.00	0.36
39	002410	广联达	41,500	813,400.00	0.36
40	002384	东山精密	28,400	808,264.00	0.35
41	600004	白云机场	54,877	806,691.90	0.35
42	000418	小天鹅 A	11,800	800,630.00	0.35
43	600879	航天电子	101,000	791,840.00	0.35
44	000488	晨鸣纸业	47,300	788,491.00	0.35
45	600388	龙净环保	45,500	787,150.00	0.35
46	002311	海大集团	33,540	784,836.00	0.34
47	002573	清新环境	34,200	777,366.00	0.34

48	601233	桐昆股份	34,509	776,107.41	0.34
49	300055	万邦达	36,700	771,801.00	0.34
50	000513	丽珠集团	11,586	769,889.70	0.34
51	002078	太阳纸业	82,600	766,528.00	0.34
52	300088	长信科技	97,700	764,991.00	0.34
53	002366	台海核电	28,700	759,115.00	0.33
54	002168	深圳惠程	55,100	758,176.00	0.33
55	600022	山东钢铁	348,770	746,367.80	0.33
56	600499	科达洁能	66,920	742,142.80	0.33
57	000690	宝新能源	92,400	739,200.00	0.32
58	600872	中炬高新	29,700	735,372.00	0.32
59	603589	口子窖	15,928	733,484.40	0.32
60	600600	青岛啤酒	18,500	727,605.00	0.32
61	601699	潞安环能	63,600	723,768.00	0.32
62	000930	中粮生化	54,200	723,028.00	0.32
63	600811	东方集团	157,730	722,403.40	0.32
64	600875	东方电气	63,600	714,228.00	0.31
65	002019	亿帆医药	32,100	714,225.00	0.31
66	000887	中鼎股份	39,300	714,081.00	0.31
67	600056	中国医药	28,400	706,876.00	0.31
68	002176	江特电机	62,400	706,368.00	0.31
69	002407	多氟多	34,400	702,448.00	0.31
70	000656	金科股份	141,800	701,910.00	0.31
71	600885	宏发股份	16,900	699,153.00	0.31
72	600166	福田汽车	247,900	696,599.00	0.31
73	000066	长城电脑	93,798	683,787.42	0.30
74	600839	四川长虹	196,100	682,428.00	0.30
75	002038	双鹭药业	21,900	678,243.00	0.30
76	600643	爱建集团	61,050	676,434.00	0.30
77	600718	东软集团	46,100	675,826.00	0.30
78	002517	恺英网络	30,400	675,184.00	0.30
79	000997	新大陆	37,619	674,508.67	0.30
80	300376	易事特	89,100	674,487.00	0.30
81	600183	生益科技	38,700	667,962.00	0.29
82	002439	启明星辰	28,600	667,810.00	0.29
83	600755	厦门国贸	66,100	667,610.00	0.29
84	002273	水晶光电	28,300	667,597.00	0.29
85	600418	江淮汽车	70,300	665,038.00	0.29
86	600325	华发股份	89,970	662,179.20	0.29

87	600260	凯乐科技	22,633	658,846.63	0.29
88	002244	滨江集团	82,600	656,670.00	0.29
89	600266	北京城建	49,918	655,922.52	0.29
90	600808	马钢股份	158,436	654,340.68	0.29
91	000970	中科三环	45,300	651,414.00	0.29
92	002359	齐星铁塔	28,770	648,763.50	0.28
93	600138	中青旅	30,800	642,796.00	0.28
94	600787	中储股份	58,400	642,400.00	0.28
95	000878	云南铜业	45,200	641,388.00	0.28
96	000581	威孚高科	26,700	640,800.00	0.28
97	300383	光环新网	48,500	639,715.00	0.28
98	600060	海信电器	41,600	624,832.00	0.27
99	002223	鱼跃医疗	31,850	624,260.00	0.27
100	600673	东阳光科	91,800	619,650.00	0.27
101	002670	国盛金控	31,760	617,732.00	0.27
102	600460	士兰微	39,800	614,114.00	0.27
103	002195	二三四五	104,700	611,448.00	0.27
104	000547	航天发展	56,300	609,729.00	0.27
105	002285	世联行	54,159	603,872.85	0.26
106	000825	太钢不锈	121,000	600,160.00	0.26
107	002408	齐翔腾达	47,181	598,255.08	0.26
108	600160	巨化股份	56,000	595,280.00	0.26
109	600094	大名城	84,500	590,655.00	0.26
110	300197	铁汉生态	48,400	588,060.00	0.26
111	300146	汤臣倍健	39,100	587,282.00	0.26
112	600435	北方导航	47,500	585,675.00	0.26
113	000960	锡业股份	44,300	584,760.00	0.26
114	300182	捷成股份	67,800	583,758.00	0.26
115	002640	跨境通	30,400	581,856.00	0.26
116	600884	杉杉股份	29,900	579,462.00	0.25
117	300115	长盈精密	28,780	577,614.60	0.25
118	000566	海南海药	44,700	576,183.00	0.25
119	600978	宜华生活	63,000	575,820.00	0.25
120	600655	豫园股份	53,430	573,838.20	0.25
121	600062	华润双鹤	23,160	573,210.00	0.25
122	600614	鹏起科技	56,200	570,992.00	0.25
123	601000	唐山港	121,020	570,004.20	0.25
124	600143	金发科技	86,600	568,962.00	0.25
125	600282	南钢股份	117,100	566,764.00	0.25

126	000703	恒逸石化	26,262	566,471.34	0.25
127	000981	银亿股份	64,100	566,003.00	0.25
128	000999	华润三九	20,800	565,760.00	0.25
129	000807	云铝股份	55,300	565,719.00	0.25
130	000979	中弘股份	288,960	560,582.40	0.25
131	600503	华丽家族	85,100	557,405.00	0.24
132	600179	安通控股	22,500	556,875.00	0.24
133	002183	怡亚通	78,700	554,835.00	0.24
134	000778	新兴铸管	106,000	553,320.00	0.24
135	600970	中材国际	55,900	552,851.00	0.24
136	002013	中航机电	51,183	552,264.57	0.24
137	601231	环旭电子	34,700	547,219.00	0.24
138	002051	中工国际	29,529	544,219.47	0.24
139	002512	达华智能	30,100	543,907.00	0.24
140	002048	宁波华翔	22,600	537,880.00	0.24
141	002589	瑞康医药	39,890	536,520.50	0.24
142	002221	东华能源	43,800	534,798.00	0.23
143	000006	深振业 A	54,200	533,870.00	0.23
144	000988	华工科技	32,100	532,218.00	0.23
145	600161	天坛生物	18,460	531,463.40	0.23
146	000732	泰禾集团	26,499	530,509.98	0.23
147	002127	南极电商	43,500	530,265.00	0.23
148	600125	铁龙物流	48,600	525,852.00	0.23
149	600409	三友化工	54,800	525,532.00	0.23
150	000592	平潭发展	90,700	521,525.00	0.23
151	600240	华业资本	60,500	519,090.00	0.23
152	000401	冀东水泥	37,600	518,504.00	0.23
153	000598	兴蓉环境	95,200	516,936.00	0.23
154	002373	千方科技	35,200	515,680.00	0.23
155	002268	卫士通	22,300	513,346.00	0.23
156	002745	木林森	11,200	509,600.00	0.22
157	002004	华邦健康	75,650	509,124.50	0.22
158	002491	通鼎互联	40,200	506,520.00	0.22
159	000031	中粮地产	63,300	506,400.00	0.22
160	000729	燕京啤酒	74,900	504,826.00	0.22
161	002030	达安基因	26,980	501,288.40	0.22
162	000078	海王生物	84,400	497,960.00	0.22
163	600597	光明乳业	32,600	493,890.00	0.22
164	600410	华胜天成	46,920	493,598.40	0.22

165	002400	省广股份	92,479	492,913.07	0.22
166	600566	济川药业	12,900	492,135.00	0.22
167	600635	大众公用	102,800	491,384.00	0.22
168	002281	光迅科技	16,700	490,980.00	0.22
169	002354	天神娱乐	28,400	485,640.00	0.21
170	600664	哈药股份	83,426	484,705.06	0.21
171	002440	闰土股份	24,500	482,405.00	0.21
172	000028	国药一致	8,000	482,000.00	0.21
173	000685	中山公用	47,000	481,750.00	0.21
174	600645	中源协和	16,900	479,960.00	0.21
175	600037	歌华有线	36,900	479,331.00	0.21
176	002152	广电运通	64,400	479,136.00	0.21
177	000975	银泰资源	35,831	478,702.16	0.21
178	600122	宏图高科	49,100	475,779.00	0.21
179	600307	酒钢宏兴	166,300	475,618.00	0.21
180	000012	南玻A	56,191	474,813.95	0.21
181	000089	深圳机场	54,500	474,150.00	0.21
182	600348	阳泉煤业	63,900	471,582.00	0.21
183	600572	康恩贝	66,654	471,243.78	0.21
184	600500	中化国际	55,300	467,838.00	0.21
185	600380	健康元	41,800	467,742.00	0.21
186	002056	横店东磁	43,700	467,590.00	0.21
187	600171	上海贝岭	28,700	466,949.00	0.20
188	600717	天津港	44,500	466,805.00	0.20
189	600267	海正药业	30,800	466,312.00	0.20
190	002131	利欧股份	178,709	464,643.40	0.20
191	601200	上海环境	18,600	463,884.00	0.20
192	002431	棕榈股份	55,200	463,680.00	0.20
193	601880	大连港	164,340	458,508.60	0.20
194	600863	内蒙华电	154,200	457,974.00	0.20
195	002506	协鑫集成	107,100	457,317.00	0.20
196	300324	旋极信息	31,200	456,456.00	0.20
197	600881	亚泰集团	86,300	455,664.00	0.20
198	300058	蓝色光标	82,200	453,744.00	0.20
199	600511	国药股份	16,300	453,140.00	0.20
200	000636	风华高科	38,100	452,628.00	0.20
201	002665	首航节能	67,410	448,950.60	0.20
202	002028	思源电气	28,320	448,872.00	0.20
203	300002	神州泰岳	72,900	446,148.00	0.20

204	600026	中远海能	72,659	444,673.08	0.19
205	002477	雏鹰农牧	99,900	443,556.00	0.19
206	002280	联络互动	57,700	441,982.00	0.19
207	002191	劲嘉股份	47,700	441,225.00	0.19
208	600120	浙江东方	17,900	440,519.00	0.19
209	000926	福星股份	40,400	439,956.00	0.19
210	600416	湘电股份	35,100	438,399.00	0.19
211	002249	大洋电机	62,800	437,716.00	0.19
212	000939	凯迪生态	87,700	437,623.00	0.19
213	300166	东方国信	34,778	436,463.90	0.19
214	300159	新研股份	41,600	432,640.00	0.19
215	600967	内蒙一机	35,897	432,558.85	0.19
216	600737	中粮糖业	54,400	432,480.00	0.19
217	600936	广西广电	61,916	424,743.76	0.19
218	000400	许继电气	32,200	424,718.00	0.19
219	600466	蓝光发展	45,400	424,490.00	0.19
220	600835	上海机电	17,200	421,400.00	0.18
221	600633	浙数文化	27,700	421,040.00	0.18
222	600751	天海投资	68,400	417,924.00	0.18
223	600575	皖江物流	103,100	417,555.00	0.18
224	000806	银河生物	38,800	417,488.00	0.18
225	000612	焦作万方	44,400	417,360.00	0.18
226	002635	安洁科技	15,983	416,996.47	0.18
227	000693	ST 华泽	33,300	416,250.00	0.18
228	600216	浙江医药	30,800	413,952.00	0.18
229	002709	天赐材料	9,000	413,910.00	0.18
230	002505	大康农业	145,570	413,418.80	0.18
231	000667	美好集团	135,900	413,136.00	0.18
232	300244	迪安诊断	17,480	412,877.60	0.18
233	603369	今世缘	26,600	412,566.00	0.18
234	000860	顺鑫农业	21,300	409,173.00	0.18
235	300026	红日药业	96,000	408,960.00	0.18
236	600064	南京高科	28,800	408,672.00	0.18
237	000596	古井贡酒	6,200	407,154.00	0.18
238	002371	七星电子	9,815	406,733.60	0.18
239	300133	华策影视	37,500	406,500.00	0.18
240	600598	北大荒	37,700	406,406.00	0.18
241	300199	翰宇药业	24,901	405,388.28	0.18
242	300113	顺网科技	22,100	404,209.00	0.18

243	000712	锦龙股份	23,800	404,124.00	0.18
244	000758	中色股份	62,800	403,804.00	0.18
245	600151	航天机电	53,200	403,788.00	0.18
246	600478	科力远	54,604	402,977.52	0.18
247	002353	杰瑞股份	30,500	400,160.00	0.18
248	300253	卫宁健康	59,430	398,775.30	0.17
249	002603	以岭药业	25,600	398,336.00	0.17
250	002444	巨星科技	28,600	395,538.00	0.17
251	300287	飞利信	53,300	394,953.00	0.17
252	603766	隆鑫通用	56,150	394,173.00	0.17
253	600823	世茂股份	79,600	393,224.00	0.17
254	300116	坚瑞消防	51,600	393,192.00	0.17
255	002701	奥瑞金	62,580	391,125.00	0.17
256	600039	四川路桥	95,862	390,158.34	0.17
257	002807	江阴银行	46,900	388,332.00	0.17
258	600908	无锡银行	49,000	385,630.00	0.17
259	002128	露天煤业	34,740	384,919.20	0.17
260	000027	深圳能源	63,200	382,992.00	0.17
261	002390	信邦制药	45,300	382,785.00	0.17
262	600086	东方金钰	35,900	382,335.00	0.17
263	000021	深科技	39,100	380,443.00	0.17
264	600017	日照港	98,000	380,240.00	0.17
265	002299	圣农发展	26,300	378,720.00	0.17
266	002147	新光圆成	29,030	375,648.20	0.16
267	002002	鸿达兴业	54,908	375,570.72	0.16
268	603077	和邦生物	187,560	375,120.00	0.16
269	002155	湖南黄金	38,304	371,548.80	0.16
270	600158	中体产业	35,900	369,052.00	0.16
271	600648	外高桥	19,900	368,150.00	0.16
272	600801	华新水泥	25,900	365,967.00	0.16
273	600563	法拉电子	7,200	365,832.00	0.16
274	600366	宁波韵升	20,800	364,416.00	0.16
275	002266	浙富控股	84,080	364,066.40	0.16
276	300001	特锐德	26,500	362,785.00	0.16
277	000681	视觉中国	18,591	362,524.50	0.16
278	600848	上海临港	16,200	361,260.00	0.16
279	600312	平高电气	36,100	360,639.00	0.16
280	601678	滨化股份	44,160	358,579.20	0.16
281	000528	柳工	41,838	356,878.14	0.16

282	002672	东江环保	21,950	356,687.50	0.16
283	002308	威创股份	29,200	356,240.00	0.16
284	002032	苏泊尔	8,700	351,306.00	0.15
285	600317	营口港	103,000	349,170.00	0.15
286	000563	陕国投 A	82,100	348,925.00	0.15
287	000718	苏宁环球	80,500	348,565.00	0.15
288	000762	西藏矿业	22,150	347,755.00	0.15
289	002489	浙江永强	57,850	347,678.50	0.15
290	000156	华数传媒	30,400	346,560.00	0.15
291	600594	益佰制药	33,700	344,414.00	0.15
292	000727	华东科技	144,300	343,434.00	0.15
293	002018	华信国际	48,400	342,188.00	0.15
294	000877	天山股份	32,800	341,120.00	0.15
295	600393	粤泰股份	53,800	341,092.00	0.15
296	600108	亚盛集团	82,700	339,897.00	0.15
297	600187	国中水务	72,200	337,896.00	0.15
298	600859	王府井	16,560	337,824.00	0.15
299	600651	飞乐音响	36,900	337,635.00	0.15
300	002368	太极股份	13,300	337,421.00	0.15
301	300134	大富科技	20,436	336,172.20	0.15
302	002428	云南锗业	27,800	335,546.00	0.15
303	002437	誉衡药业	48,457	333,868.73	0.15
304	600270	外运发展	19,300	333,504.00	0.15
305	002463	沪电股份	62,300	332,059.00	0.15
306	600545	卓郎智能	30,200	331,596.00	0.15
307	600611	大众交通	66,400	330,672.00	0.15
308	002251	步步高	18,310	330,495.50	0.14
309	600169	太原重工	95,300	329,738.00	0.14
310	600993	马应龙	16,090	329,523.20	0.14
311	601928	凤凰传媒	40,600	329,266.00	0.14
312	000937	冀中能源	56,300	327,666.00	0.14
313	000501	鄂武商 A	20,470	326,701.20	0.14
314	600729	重庆百货	13,000	325,780.00	0.14
315	600316	洪都航空	22,900	324,264.00	0.14
316	002122	天马股份	37,900	321,771.00	0.14
317	002375	亚厦股份	42,700	321,104.00	0.14
318	000090	天健集团	31,880	320,075.20	0.14
319	603000	人民网	29,400	318,402.00	0.14
320	600259	广晟有色	8,100	318,249.00	0.14

321	002663	普邦园林	57,200	317,460.00	0.14
322	600694	大商股份	9,400	317,062.00	0.14
323	600141	兴发集团	18,700	316,030.00	0.14
324	000587	金洲慈航	45,100	315,700.00	0.14
325	600770	综艺股份	41,500	315,400.00	0.14
326	002250	联化科技	29,500	313,290.00	0.14
327	601717	郑煤机	47,500	312,550.00	0.14
328	600557	康缘药业	22,960	309,500.80	0.14
329	600565	迪马股份	77,200	308,800.00	0.14
330	002277	友阿股份	52,600	308,762.00	0.14
331	600098	广州发展	43,500	307,545.00	0.13
332	600582	天地科技	66,000	306,900.00	0.13
333	002358	森源电气	20,600	306,116.00	0.13
334	002064	华峰氨纶	62,400	305,760.00	0.13
335	603188	亚邦股份	18,400	305,256.00	0.13
336	002106	莱宝高科	30,000	305,100.00	0.13
337	600874	创业环保	23,100	300,531.00	0.13
338	002233	塔牌集团	25,220	300,370.20	0.13
339	002434	万里扬	28,600	300,300.00	0.13
340	601311	骆驼股份	22,600	299,450.00	0.13
341	600765	中航重机	24,800	298,096.00	0.13
342	002022	科华生物	21,800	296,698.00	0.13
343	300297	蓝盾股份	31,100	296,694.00	0.13
344	000848	承德露露	31,190	295,057.40	0.13
345	002123	梦网荣信	28,500	294,975.00	0.13
346	000519	江南红箭	29,862	294,140.70	0.13
347	000766	通化金马	21,600	293,760.00	0.13
348	000600	建投能源	38,100	293,751.00	0.13
349	000426	兴业矿业	29,800	292,934.00	0.13
350	600338	西藏珠峰	7,000	291,550.00	0.13
351	000969	安泰科技	32,700	290,703.00	0.13
352	000829	天音控股	30,600	290,700.00	0.13
353	601016	节能风电	88,300	290,507.00	0.13
354	600587	新华医疗	17,300	290,467.00	0.13
355	603883	老百姓	4,600	289,754.00	0.13
356	002657	中科金财	12,600	287,532.00	0.13
357	000541	佛山照明	31,200	287,040.00	0.13
358	601689	拓普集团	11,600	286,984.00	0.13
359	000543	皖能电力	57,070	286,491.40	0.13

360	002276	万马股份	33,000	284,460.00	0.12
361	600155	宝硕股份	27,700	283,371.00	0.12
362	600073	上海梅林	34,875	283,185.00	0.12
363	600277	亿利洁能	43,700	281,428.00	0.12
364	600687	刚泰控股	23,800	281,078.00	0.12
365	000572	海马汽车	61,200	280,296.00	0.12
366	000158	常山股份	35,170	279,249.80	0.12
367	002073	软控股份	34,800	278,400.00	0.12
368	002332	仙琚制药	34,050	278,188.50	0.12
369	600754	锦江股份	8,600	277,694.00	0.12
370	002690	美亚光电	14,400	277,488.00	0.12
371	600971	恒源煤电	26,600	277,438.00	0.12
372	002242	九阳股份	16,326	277,052.22	0.12
373	000061	农产品	36,100	276,526.00	0.12
374	600058	五矿发展	22,845	275,967.60	0.12
375	002503	搜于特	49,760	275,670.40	0.12
376	002317	众生药业	21,700	275,156.00	0.12
377	600580	卧龙电气	34,300	274,743.00	0.12
378	600284	浦东建设	29,500	274,350.00	0.12
379	002261	拓维信息	35,400	273,996.00	0.12
380	002063	远光软件	25,650	272,659.50	0.12
381	600773	西藏城投	23,300	272,144.00	0.12
382	600300	维维股份	62,200	271,814.00	0.12
383	601002	晋亿实业	25,300	271,469.00	0.12
384	300010	立思辰	24,300	271,431.00	0.12
385	600869	智慧能源	47,100	270,354.00	0.12
386	000062	深圳华强	11,500	270,135.00	0.12
387	601001	大同煤业	44,500	269,225.00	0.12
388	600422	昆药集团	29,400	269,010.00	0.12
389	000680	山推股份	52,700	268,243.00	0.12
390	603377	东方时尚	6,700	267,866.00	0.12
391	300273	和佳股份	29,318	265,621.08	0.12
392	603816	顾家家居	4,500	265,365.00	0.12
393	000669	金鸿能源	18,100	265,165.00	0.12
394	600578	京能电力	71,600	264,920.00	0.12
395	002254	泰和新材	22,740	264,693.60	0.12
396	002642	荣之联	20,150	264,166.50	0.12
397	002699	美盛文化	14,560	263,681.60	0.12
398	300202	聚龙股份	14,670	263,326.50	0.12

399	002681	奋达科技	23,560	262,929.60	0.12
400	002482	广田集团	32,700	262,254.00	0.12
401	600536	中国软件	15,800	261,490.00	0.11
402	603515	欧普照明	6,100	261,324.00	0.11
403	000049	德赛电池	6,600	261,294.00	0.11
404	002544	杰赛科技	16,500	259,545.00	0.11
405	002345	潮宏基	24,100	259,075.00	0.11
406	600458	时代新材	25,600	257,792.00	0.11
407	300257	开山股份	18,300	256,200.00	0.11
408	600759	洲际油气	60,090	255,983.40	0.11
409	600428	中远海特	45,599	255,810.39	0.11
410	600623	华谊集团	29,800	254,194.00	0.11
411	300039	上海凯宝	39,740	252,746.40	0.11
412	300032	金龙机电	18,100	251,409.00	0.11
413	601777	力帆股份	34,600	251,196.00	0.11
414	001696	宗申动力	39,500	249,640.00	0.11
415	600006	东风汽车	42,500	248,625.00	0.11
416	002479	富春环保	25,400	246,634.00	0.11
417	600289	ST 信通	24,700	245,518.00	0.11
418	002005	德豪润达	56,300	245,468.00	0.11
419	300291	华录百纳	21,622	245,409.70	0.11
420	600335	国机汽车	21,800	245,032.00	0.11
421	600750	江中药业	9,600	244,608.00	0.11
422	000777	中核科技	16,300	242,870.00	0.11
423	002707	众信旅游	22,300	242,847.00	0.11
424	600059	古越龙山	25,800	242,262.00	0.11
425	000652	泰达股份	54,900	242,109.00	0.11
426	600395	盘江股份	35,200	241,824.00	0.11
427	002041	登海种业	18,750	240,937.50	0.11
428	600280	中央商场	30,500	240,035.00	0.11
429	002011	盾安环境	29,272	235,346.88	0.10
430	603658	安图生物	4,400	234,168.00	0.10
431	600517	置信电气	36,000	232,920.00	0.10
432	000897	津滨发展	68,700	232,206.00	0.10
433	600639	浦东金桥	13,600	230,520.00	0.10
434	000990	诚志股份	13,300	229,558.00	0.10
435	002344	海宁皮城	28,900	229,177.00	0.10
436	603328	依顿电子	15,800	226,730.00	0.10
437	600195	中牧股份	11,500	226,665.00	0.10

438	600329	中新药业	15,200	226,024.00	0.10
439	600657	信达地产	40,500	225,990.00	0.10
440	603198	迎驾贡酒	12,800	225,152.00	0.10
441	600757	长江传媒	32,300	224,485.00	0.10
442	603556	海兴电力	6,100	222,040.00	0.10
443	603444	吉比特	1,200	220,716.00	0.10
444	300147	香雪制药	24,600	220,662.00	0.10
445	002269	美邦服饰	66,700	219,443.00	0.10
446	600862	中航高科	22,200	214,896.00	0.09
447	600880	博瑞传播	40,700	214,489.00	0.09
448	600894	广日股份	22,900	214,115.00	0.09
449	000552	靖远煤电	60,800	214,016.00	0.09
450	002342	巨力索具	35,700	213,843.00	0.09
451	600628	新世界	20,700	210,519.00	0.09
452	603355	莱克电气	4,200	206,976.00	0.09
453	002588	史丹利	30,800	206,052.00	0.09
454	002118	紫鑫药业	27,198	204,528.96	0.09
455	000099	中信海直	22,600	203,852.00	0.09
456	002093	国脉科技	21,400	203,086.00	0.09
457	300043	星辉娱乐	33,101	202,578.12	0.09
458	002916	深南电路	2,301	200,716.23	0.09
459	600184	光电股份	10,900	199,688.00	0.09
460	000662	天夏智慧	13,400	199,258.00	0.09
461	002190	成飞集成	9,200	199,088.00	0.09
462	603888	新华网	8,300	196,295.00	0.09
463	000816	智慧农业	60,300	193,563.00	0.08
464	601127	小康股份	9,600	193,056.00	0.08
465	002392	北京利尔	37,900	191,016.00	0.08
466	603868	飞科电器	2,500	189,375.00	0.08
467	002325	洪涛股份	39,670	189,225.90	0.08
468	600748	上实发展	29,420	188,582.20	0.08
469	600292	远达环保	20,760	185,802.00	0.08
470	600640	号百控股	12,700	185,674.00	0.08
471	600776	东方通信	25,400	183,642.00	0.08
472	600743	华远地产	49,860	182,487.60	0.08
473	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.08
474	600481	双良节能	43,100	172,831.00	0.08
475	601020	华钰矿业	8,300	170,316.00	0.07
476	002414	高德红外	10,000	168,100.00	0.07

477	600053	九鼎投资	7,000	167,230.00	0.07
478	600996	贵广网络	16,700	165,330.00	0.07
479	002551	尚荣医疗	17,660	161,765.60	0.07
480	002416	爱施德	16,500	156,255.00	0.07
481	603568	伟明环保	7,350	154,717.50	0.07
482	600346	恒力股份	12,500	154,125.00	0.07
483	000761	本钢板材	29,000	150,800.00	0.07
484	600826	兰生股份	11,200	147,504.00	0.06
485	603225	新凤鸣	4,100	146,780.00	0.06
486	000536	华映科技	29,407	145,270.58	0.06
487	603806	福斯特	4,200	143,220.00	0.06
488	600126	杭钢股份	20,700	142,209.00	0.06
489	000987	越秀金控	14,100	138,885.00	0.06
490	603169	兰石重装	16,400	137,596.00	0.06
491	603228	景旺电子	2,500	134,425.00	0.06
492	600618	氯碱化工	12,000	129,960.00	0.06
493	603001	奥康国际	8,600	124,442.00	0.05
494	603528	多伦科技	13,100	115,673.00	0.05
495	601811	新华文轩	8,400	112,812.00	0.05
496	000025	特力A	2,900	111,679.00	0.05
497	600917	重庆燃气	9,100	101,374.00	0.04
498	601969	海南矿业	11,400	100,890.00	0.04
499	601128	常熟银行	12,900	91,977.00	0.04
500	002815	崇达技术	2,800	88,368.00	0.04
501	603877	太平鸟	3,000	81,330.00	0.04
502	600939	重庆建工	10,500	77,910.00	0.03
503	603025	大豪科技	2,600	76,492.00	0.03
504	603569	长久物流	3,100	74,989.00	0.03
505	002818	富森美	2,300	69,713.00	0.03
506	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
507	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
508	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
509	300735	光弘科技	2,070	29,787.30	0.01
510	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
511	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
512	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
513	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	600642	申能股份	1,002,217.00	0.38
2	002049	紫光国芯	960,445.00	0.36
3	600438	通威股份	887,740.00	0.33
4	000009	中国宝安	844,082.00	0.32
5	000778	新兴铸管	830,654.00	0.31
6	600256	广汇能源	815,817.00	0.31
7	000977	浪潮信息	802,344.00	0.30
8	002583	海能达	794,326.00	0.30
9	603799	华友钴业	787,537.00	0.30
10	300376	易事特	776,099.00	0.29
11	000039	中集集团	768,271.00	0.29
12	600004	白云机场	767,662.00	0.29
13	600839	四川长虹	760,224.00	0.29
14	600885	宏发股份	725,942.00	0.27
15	600718	东软集团	716,872.00	0.27
16	300058	蓝色光标	693,726.00	0.26
17	300002	神州泰岳	685,598.65	0.26
18	000887	中鼎股份	674,547.00	0.25
19	600875	东方电气	670,922.00	0.25
20	002195	二三四五	662,814.00	0.25

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	300136	信维通信	2,769,238.00	1.04
2	002460	赣锋锂业	2,502,314.00	0.94
3	601012	隆基股份	2,224,320.00	0.84
4	600487	亨通光电	2,112,676.00	0.80

5	002572	索菲亚	1,579,767.52	0.60
6	002508	老板电器	1,571,561.42	0.59
7	603799	华友钴业	1,341,095.00	0.51
8	300296	利亚德	1,306,980.14	0.49
9	600522	中天科技	1,282,876.00	0.48
10	600682	南京新百	1,123,075.00	0.42
11	600219	南山铝业	1,118,312.00	0.42
12	600436	片仔癀	1,036,398.00	0.39
13	300122	智飞生物	999,662.40	0.38
14	002217	合力泰	989,273.00	0.37
15	000959	首钢股份	855,609.00	0.32
16	002602	世纪华通	850,057.00	0.32
17	000656	金科股份	835,076.00	0.31
18	000887	中鼎股份	813,006.00	0.31
19	600809	山西汾酒	750,704.00	0.28
20	600699	均胜电子	723,376.00	0.27

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	91,944,687.52
卖出股票收入（成交）总额	117,018,625.40

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。

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	8,586.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,020.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,606.97

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	600525	长园集团	1,104,984.20	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
349	493,749.82	169,585,484.00	98.41%	2,733,203.00	1.59%

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	张红艳	243,300.00	0.14%
2	姜晓平	235,683.00	0.14%
3	李敏慧	231,516.00	0.13%
4	王梅	231,279.00	0.13%
5	孙建兴	183,563.00	0.11%
6	陈妙琴	139,373.00	0.08%
7	陈红兰	130,575.00	0.08%
8	朱庆芳	115,758.00	0.07%
9	中信证券股份有限公司	98,771.00	0.06%
10	包宏伟	92,607.00	0.05%
	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	169,486,286.00	98.36%

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	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	68,000,000.00
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	172,318,687.00

§ 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、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	
兴业证券		299,429,012.96	48.84%	72,711.78	44.53%	-
国泰君安		272,087,067.51	35.41%	67,134.82	41.11%	-
申万宏源		232,075,020.36	15.75%	23,456.60	14.36%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
银河证券	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》（证监基金

[2007]48 号) 的有关规定要求, 我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。

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

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 7 月 19 日
6	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	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 8 月 25 日
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 10 月 27 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170101-20171231	183,486,286.00	36,000,000.00	50,000,000.00	169,486,286.00	98.36%
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>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 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

13.1.2 《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》

13.1.3 《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》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 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

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

13.2 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

13.3 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

13.3.3 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

2018 年 3 月 27 日