

国寿安保中证 500 交易型开放式
指数证券投资基金
2018 年年度报告

2018 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：2019 年 3 月 30 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 2019 年 3 月 29 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 2018 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 审计报告	12
6.1 审计报告基本信息	12
6.2 审计报告的基本内容	12
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	53
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	53
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	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末上市基金前十名持有人	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§10 开放式基金份额变动	54
§11 重大事件揭示	55
11.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4 基金投资策略的改变	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§ 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	184,318,687.00 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
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
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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-23,204,748.30	-12,215,154.18	-126,481,756.24
本期利润	-75,924,415.41	5,702,879.68	-94,764,809.74
加权平均基金份额本期利润	-0.4292	0.0307	-0.3473
本期加权平均净值利润率	-37.98%	2.33%	-27.35%
本期基金份额净值增长率	-32.58%	1.86%	-16.79%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-233,606,419.74	-144,112,337.65	-175,819,876.25
期末可供分配基金份额利润	-1.2674	-0.8363	-0.8605
期末基金资产净值	164,462,919.65	228,040,844.54	265,443,058.59
期末基金份额净值	0.8923	1.3234	1.2992
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	-58.68%	-38.72%	-39.84%

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

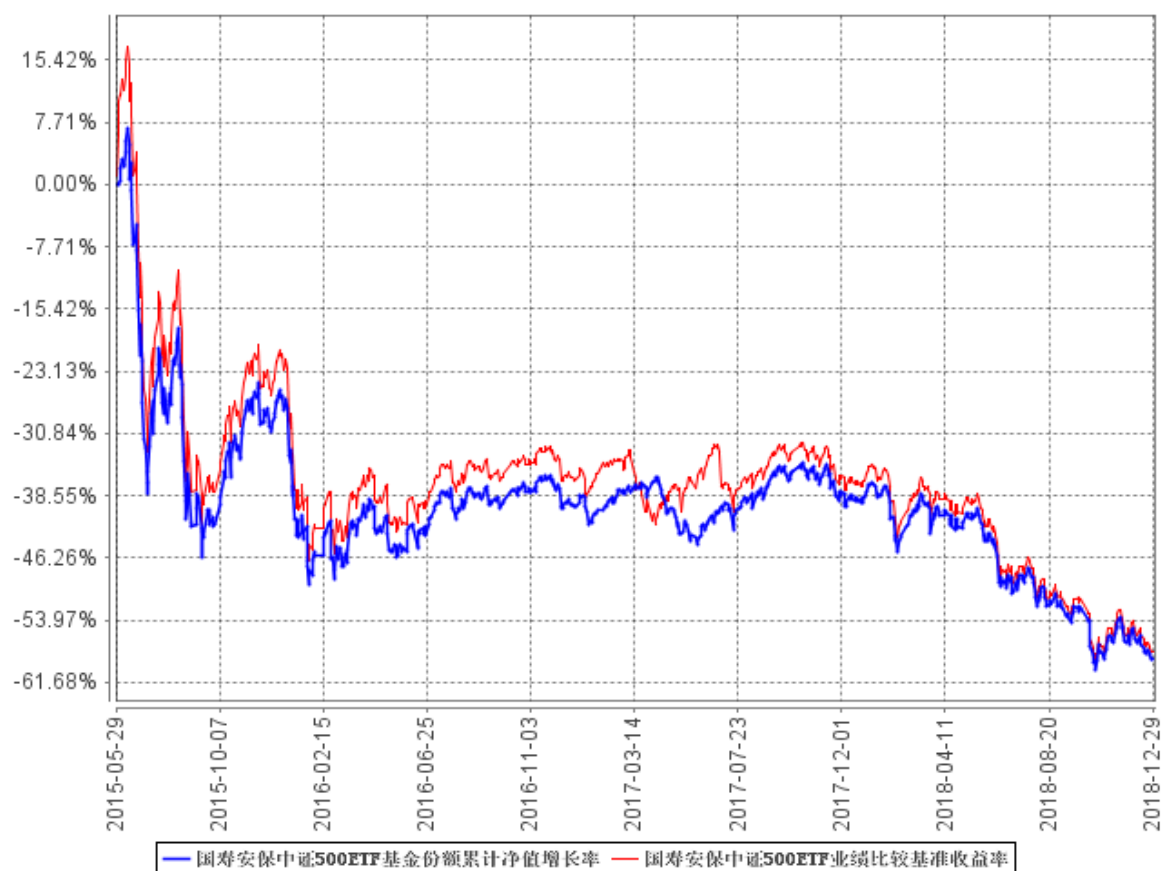
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-13.28%	1.84%	-13.18%	1.84%	-0.10%	0.00%

过去六个月	-19.97%	1.57%	-20.12%	1.58%	0.15%	-0.01%
过去一年	-32.58%	1.50%	-33.32%	1.51%	0.74%	-0.01%
过去三年	-42.85%	1.48%	-45.28%	1.55%	2.43%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-58.68%	1.88%	-57.76%	1.95%	-0.92%	-0.07%

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

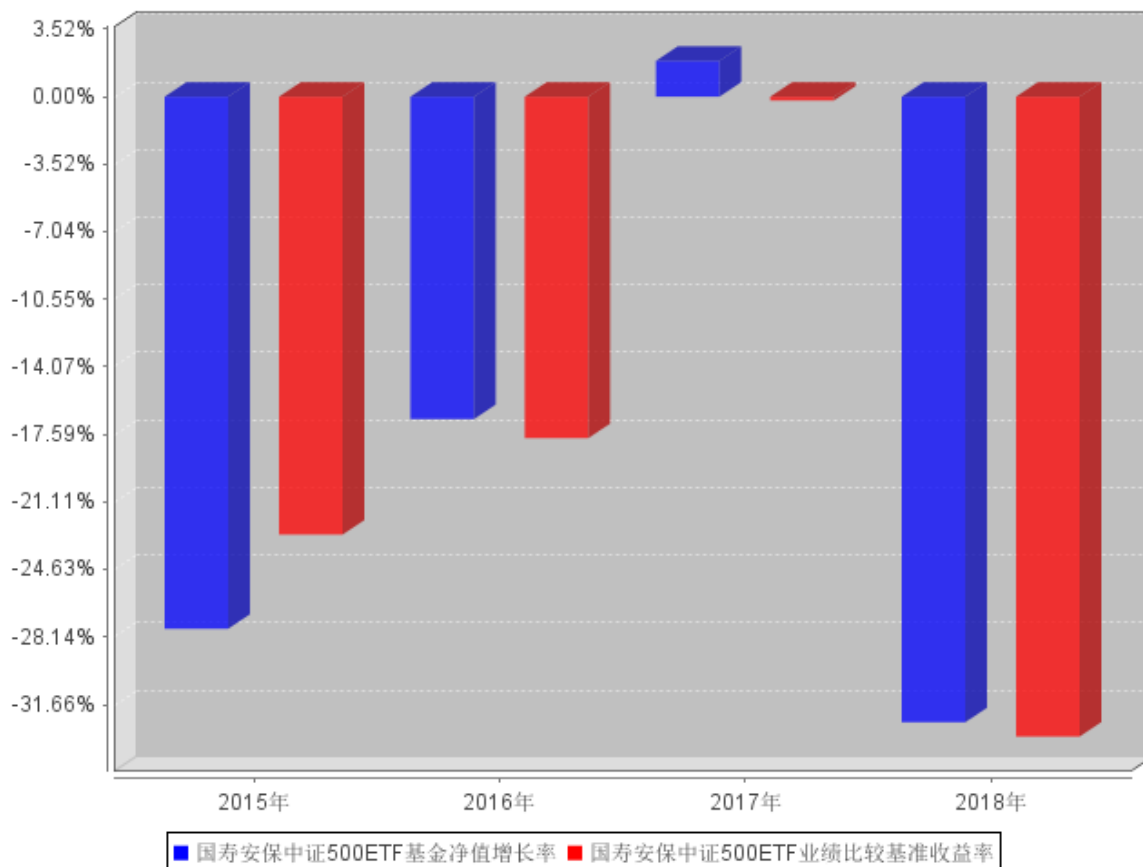
国寿安保中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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12.88亿元人民币，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（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份14.97%。截至2018年12月31日，公司共管理43只公募基金和部分资产管理计划，公司管理资产总规模为2017.49亿元，其

中公募基金管理规模 1570.15 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	-	8 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金及国寿安保沪深 300 交易型开放式指数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遵规守信情况的说明

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 0.8923 元；本报告期基金份额净值增长率为 -32.58%，业绩比较基准收益率为 -33.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2018 年全年，权益市场继续大幅调整，主要指数中，沪深 300 指数全年下跌 25.31%，创业板指下跌 28.65%，中证 500 指数全年下跌 33.32%，大盘股表现优与成长股。

展望 2019 年全年，贸易摩擦趋缓和，政策整体来看对资本市场友好，融资环境有望大幅改善，中央高层重视资本市场多层次发展的多重利好条件下，权益市场继续大幅下跌的可能性已经很低，机遇大于风险。2018 年底主要指数整体市盈率处于历史估值底部附近，配置价值突出。投资方向上，主线应该继续围绕着科技强国的思路进

行，先进制造、5G、半导体、自主可控等子版块中一批有着核心技术的公司正在崛起，将成为全年的投资重点。

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主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限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和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2019）审字第 61090605_A8 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	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 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利

	<p>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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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</p>

	<p>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，就可能导致对国寿安保中证 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>

	(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。	
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	黄悦栋	郭燕
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	2019 年 3 月 26 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,372,708.82	4,624,428.57
结算备付金		-	22,094.94
存出保证金		9,474.49	8,586.75
交易性金融资产	7.4.7.2	163,576,858.68	224,035,044.53
其中：股票投资		163,576,858.68	224,035,044.53
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	331.96	1,020.22
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		164,959,373.95	228,691,175.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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		2,426.44	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		70,357.60	96,578.53
应付托管费		14,071.52	19,315.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	39,598.74	54,436.23
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	370,000.00	480,000.00
负债合计		496,454.30	650,330.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	398,069,339.39	372,153,182.19
未分配利润	7.4.7.10	-233,606,419.74	-144,112,337.65
所有者权益合计		164,462,919.65	228,040,844.54
负债和所有者权益总计		164,959,373.95	228,691,175.01

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8923 元，基金份额总额 184,318,687.00 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-74,025,482.37	8,048,646.84
1.利息收入		17,010.01	22,074.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	17,010.01	22,074.71
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）		-21,346,729.28	-10,235,664.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-23,710,537.73	-12,111,131.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-

股利收益	7.4.7.16	2,363,808.45	1,875,466.39
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-52,719,667.11	17,918,033.86
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	23,904.01	344,203.06
减：二、费用		1,898,933.04	2,345,767.16
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	999,898.17	1,228,414.91
2. 托管费	7.4.10.2.2	199,979.58	245,683.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	236,549.81	297,425.35
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	462,505.48	574,243.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-75,924,415.41	5,702,879.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-75,924,415.41	5,702,879.68

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	372,153,182.19	-144,112,337.65	228,040,844.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-75,924,415.41	-75,924,415.41
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）	25,916,157.20	-13,569,666.68	12,346,490.52
其中：1.基金申购款	38,874,235.82	-19,089,108.13	19,785,127.69
2.基金赎回款	-12,958,078.62	5,519,441.45	-7,438,637.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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，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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	1,372,708.82	4,624,428.57
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-

存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计:	1,372,708.82	4,624,428.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	248,789,946.32	163,576,858.68	-85,213,087.64
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	248,789,946.32	163,576,858.68	-85,213,087.64
项目	上年度末 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

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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	327.23	1,004.93
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
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
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	4.73	4.29
合计	331.96	1,020.22

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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	39,598.74	54,436.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	39,598.74	54,436.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 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	320,000.00	430,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	370,000.00	480,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,318,687.00	372,153,182.19

本期申购	18,000,000.00	38,874,235.82
本期赎回(以“-”号填列)	-6,000,000.00	-12,958,078.62
- 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	184,318,687.00	398,069,339.39

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	-133,752,707.34	-10,359,630.31	-144,112,337.65
本期利润	-23,204,748.30	-52,719,667.11	-75,924,415.41
本期基金份额交易产生的变动数	-10,308,312.67	-3,261,354.01	-13,569,666.68
其中：基金申购款	-15,008,829.76	-4,080,278.37	-19,089,108.13
基金赎回款	4,700,517.09	818,924.36	5,519,441.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-167,265,768.31	-66,340,651.43	-233,606,419.74

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	15,637.17	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	1,228.16	1,125.31
其他	144.68	360.30
合计	17,010.01	22,074.71

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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-23,077,581.87	-6,185,651.78
股票投资收益——赎回差价收入	-632,955.86	-5,925,479.40
股票投资收益——申购差价收入	-	-

合计	-23,710,537.73	-12,111,131.18
----	----------------	----------------

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 2018年1月1日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	79,976,621.24	117,018,625.40
减：卖出股票成本总额	103,054,203.11	123,204,277.18
买卖股票差价收入	-23,077,581.87	-6,185,651.78

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 2018年1月1日至 2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年12月31日
赎回基金份额对价总额	7,438,637.17	91,509,388.37
减：现金支付赎回款总额	3,970,252.17	48,174,000.37
减：赎回股票成本总额	4,101,340.86	49,260,867.40
赎回差价收入	-632,955.86	-5,925,479.40

7.4.7.13 债券投资收益

本基金于本报告期间及上年度均无买卖债券投资收益。

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 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日
股票投资产生的股利收益	2,363,808.45	1,875,466.39
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,363,808.45	1,875,466.39

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-52,719,667.11	17,918,033.86
——股票投资	-52,719,667.11	17,918,033.86
——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	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-52,719,667.11	17,918,033.86

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他	40,000.00	-
替代损益	-16,095.99	344,203.06
合计	23,904.01	344,203.06

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	236,549.81	297,425.35
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	236,549.81	297,425.35

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	150,000.00	260,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
银行费用	2,505.48	4,243.87
其他	-	-
合计	462,505.48	574,243.87

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	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
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（“国寿安保中证 500ETF 联接基金”）	本基金的联接基金

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	999,898.17	1,228,414.91
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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	199,979.58	245,683.03

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

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

关联方名称	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
国寿安保中证 500ETF 联接基 金	179,486,286.00	97.38%	169,486,286.00	98.36%

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,372,708.82	15,637.17	4,624,428.57	20,589.10

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期未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（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600270	外运发展	2018年12月13日	重大资产重组	20.99	注	注	20,000	473,800.94	419,800.00	注
002183	怡亚通	2018年12月25日	重大事项	5.01	2019年1月2日	4.96	80,700	578,438.83	404,307.00	-
000987	越秀金控	2018年12月25日	重大事项	7.97	2019年1月10日	8.77	15,200	155,749.21	121,144.00	-
000693	ST华泽	2018年5月2日	重大事项	3.31	-	-	33,300	809,235.39	110,223.00	-

注：根据中外运空运发展股份有限公司（简称“外运发展”）于2018年12月24日发布的《外运发展关于公司股票终止上市的公告》，外运发展于2018年12月28日终止上市，换股股权登记日收市后，登记在册的除中国外运股份有限公司（简称“中国外运”）以外的外运发展全体股东持有的外运发展股票将按照1:3.8225的比例转换为中国外运的A股股票。中国外运已于2019年1月18日在上海证券交易所上市交易，股票代码为601598，开盘单价为人民币5.30元。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

岗位自控构成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

7.4.13.3.2 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，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 2018 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	1,372,708.82	-	-	-	1,372,708.82
存出保证金	9,474.49	-	-	-	9,474.49
交易性金融资产	-	-	-	163,576,858.68	163,576,858.68
应收利息	-	-	-	331.96	331.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,382,183.31	-	-	163,577,190.64	164,959,373.95
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	70,357.60	70,357.60
应付托管费	-	-	-	14,071.52	14,071.52
应付交易费用	-	-	-	39,598.74	39,598.74
其他负债	-	-	-	370,000.00	370,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,426.44	2,426.44
负债总计	-	-	-	496,454.30	496,454.30
利率敏感度缺口	1,382,183.31	-	-	163,080,736.34	164,462,919.65
上年度末 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
应付证券清算款	-	-	-	-	-
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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	163,576,858.68	99.46	224,035,044.53	98.24
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	163,576,858.68	99.46	224,035,044.53	98.24

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 系数是根据组合的净值数据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（2018 年 12 月	上年度末（2017 年 12 月

		31 日)	31 日)
	+5%	8,169,017.26	11,219,846.58
	-5%	-8,169,017.26	-11,219,846.58

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 2018 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 162,521,384.68 元（上年度末：206,688,101.91 元），属于第二层次的余额为人民币 1,055,474.00 元（上年度末：17,346,942.62 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 2019 年 3 月 29 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	163,576,858.68	99.16
	其中：股票	163,576,858.68	99.16
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	1,372,708.82	0.83
8	其他各项资产	9,806.45	0.01
9	合计	164,959,373.95	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	1,683,419.50	1.02
B	采矿业	5,273,032.69	3.21
C	制造业	92,523,227.07	56.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,204,089.30	3.16
E	建筑业	3,028,684.28	1.84
F	批发和零售业	8,700,512.44	5.29
G	交通运输、仓储和邮政业	5,792,850.19	3.52
H	住宿和餐饮业	615,487.20	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,752,364.91	8.97
J	金融业	5,450,669.38	3.31
K	房地产业	9,196,598.46	5.59
L	租赁和商务服务业	2,601,649.84	1.58
M	科学研究和技术服务业	274,456.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,169,081.00	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	140,744.00	0.09
Q	卫生和社会工作	1,049,289.60	0.64
R	文化、体育和娱乐业	4,567,606.82	2.78
S	综合	1,553,096.00	0.94
	合计	163,576,858.68	99.46

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沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600201	生物股份	63,514	1,054,332.40	0.64
2	603899	晨光文具	29,800	901,450.00	0.55
3	000656	金科股份	144,900	896,931.00	0.55
4	600872	中炬高新	30,400	895,584.00	0.54
5	600256	广汇能源	219,350	824,756.00	0.50
6	300146	汤臣倍健	47,700	810,423.00	0.49
7	300347	泰格医药	18,200	778,050.00	0.47
8	300253	卫宁健康	61,430	765,417.80	0.47
9	002410	广联达	36,600	761,646.00	0.46
10	600426	华鲁恒升	62,275	751,659.25	0.46
11	600642	申能股份	149,200	728,096.00	0.44
12	000623	吉林敖东	48,600	701,298.00	0.43
13	000750	国海证券	159,900	697,164.00	0.42
14	600699	均胜电子	29,800	696,128.00	0.42
15	600298	安琪酵母	27,150	684,994.50	0.42
16	002465	海格通信	87,800	684,840.00	0.42
17	601005	重庆钢铁	353,000	684,820.00	0.42
18	000860	顺鑫农业	21,400	682,446.00	0.41
19	000998	隆平高科	45,800	677,840.00	0.41
20	002049	紫光国微	23,200	670,480.00	0.41
21	300450	先导智能	23,116	668,977.04	0.41
22	600600	青岛啤酒	19,000	662,340.00	0.40
23	002129	中环股份	90,600	655,038.00	0.40
24	000778	新兴铸管	151,200	651,672.00	0.40
25	600879	航天电子	119,100	644,331.00	0.39
26	002223	鱼跃医疗	32,750	642,227.50	0.39
27	600528	中铁工业	60,947	639,943.50	0.39

28	600895	张江高科	42,500	635,375.00	0.39
29	000690	宝新能源	94,200	633,966.00	0.39
30	000401	冀东水泥	51,200	633,856.00	0.39
31	300383	光环新网	49,900	632,233.00	0.38
32	600820	隧道股份	99,300	621,618.00	0.38
33	002195	二三四五	167,950	619,735.50	0.38
34	601168	西部矿业	104,266	606,828.12	0.37
35	002340	格林美	157,478	604,715.52	0.37
36	600673	东阳光科	82,500	600,600.00	0.37
37	002439	启明星辰	29,100	598,296.00	0.36
38	600811	东方集团	162,630	595,225.80	0.36
39	002384	东山精密	51,800	584,822.00	0.36
40	600881	亚泰集团	174,500	577,595.00	0.35
41	300413	快乐购	15,600	577,356.00	0.35
42	600183	生益科技	57,285	576,287.10	0.35
43	600325	华发股份	92,770	575,174.00	0.35
44	002092	中泰化学	81,302	573,179.10	0.35
45	600779	水井坊	18,000	570,060.00	0.35
46	002281	光迅科技	21,100	566,746.00	0.34
47	600808	马钢股份	163,436	565,488.56	0.34
48	002268	卫士通	31,500	562,590.00	0.34
49	000997	新大陆	38,319	560,990.16	0.34
50	000581	威孚高科	31,700	559,822.00	0.34
51	600022	山东钢铁	356,170	559,186.90	0.34
52	600885	宏发股份	24,640	555,878.40	0.34
53	000975	银泰资源	53,923	549,475.37	0.33
54	002506	协鑫集成	109,800	549,000.00	0.33
55	600718	东软集团	47,500	548,625.00	0.33
56	300168	万达信息	45,712	548,086.88	0.33
57	000830	鲁西化工	55,700	545,860.00	0.33
58	002038	双鹭药业	22,000	545,820.00	0.33
59	002470	金正大	85,900	542,888.00	0.33
60	002507	涪陵榨菜	24,800	535,680.00	0.33
61	002174	游族网络	28,700	533,533.00	0.32
62	002358	森源电气	29,900	532,220.00	0.32
63	600804	鹏博士	75,600	531,468.00	0.32
64	300315	掌趣科技	149,500	527,735.00	0.32
65	000999	华润三九	21,200	527,032.00	0.32
66	600567	山鹰纸业	168,400	525,408.00	0.32

67	000681	视觉中国	22,491	524,490.12	0.32
68	002500	山西证券	88,500	523,920.00	0.32
69	600079	人福医药	51,420	521,398.80	0.32
70	000060	中金岭南	130,400	516,384.00	0.31
71	000960	锡业股份	54,100	516,114.00	0.31
72	600572	康恩贝	86,954	515,637.22	0.31
73	002013	中航机电	78,574	511,516.74	0.31
74	000418	小天鹅A	11,800	510,350.00	0.31
75	000039	中集集团	48,200	509,956.00	0.31
76	600143	金发科技	102,900	509,355.00	0.31
77	600161	天坛生物	23,798	505,707.50	0.31
78	002221	东华能源	62,500	503,750.00	0.31
79	000009	中国宝安	116,700	502,977.00	0.31
80	600315	上海家化	18,400	502,320.00	0.31
81	002127	南极电商	66,400	499,328.00	0.30
82	600392	盛和资源	57,595	495,892.95	0.30
83	600282	南钢股份	144,600	494,532.00	0.30
84	600160	巨化股份	74,520	494,067.60	0.30
85	300274	阳光电源	55,220	492,562.40	0.30
86	601098	中南传媒	39,200	490,000.00	0.30
87	601872	招商轮船	132,600	489,294.00	0.30
88	600376	首开股份	68,000	488,920.00	0.30
89	600755	厦门国贸	69,800	487,204.00	0.30
90	600967	内蒙一机	46,297	481,488.80	0.29
91	002078	太阳纸业	84,400	481,080.00	0.29
92	300027	华谊兄弟	102,200	479,318.00	0.29
93	601866	中远海发	209,300	477,204.00	0.29
94	600875	东方电气	60,400	476,556.00	0.29
95	000686	东北证券	76,000	475,760.00	0.29
96	000008	神州高铁	122,200	475,358.00	0.29
97	300001	特锐德	27,000	473,310.00	0.29
98	600655	豫园股份	63,730	471,602.00	0.29
99	603077	和邦生物	289,860	469,573.20	0.29
100	000547	航天发展	61,900	467,964.00	0.28
101	002399	海普瑞	20,300	467,915.00	0.28
102	600839	四川长虹	202,100	466,851.00	0.28
103	002463	沪电股份	65,100	466,767.00	0.28
104	002176	江特电机	79,000	463,730.00	0.28
105	600260	凯乐科技	27,233	462,144.01	0.28

106	600166	福田汽车	253,500	461,370.00	0.28
107	600021	上海电力	56,600	458,460.00	0.28
108	002110	三钢闽光	35,600	455,324.00	0.28
109	600643	爱建集团	53,350	452,941.50	0.28
110	000066	长城电脑	95,298	451,712.52	0.27
111	600801	华新水泥	26,700	446,424.00	0.27
112	000813	德展健康	48,500	445,230.00	0.27
113	002299	圣农发展	26,800	443,272.00	0.27
114	002373	千方科技	39,700	441,464.00	0.27
115	600466	蓝光发展	81,620	439,115.60	0.27
116	600584	长电科技	52,700	434,248.00	0.26
117	000089	深圳机场	55,700	433,903.00	0.26
118	000729	燕京啤酒	76,200	429,768.00	0.26
119	600258	首旅酒店	26,820	428,047.20	0.26
120	002670	国盛金控	42,236	425,738.88	0.26
121	600277	亿利洁能	74,900	423,934.00	0.26
122	002372	伟星新材	27,300	423,423.00	0.26
123	600959	江苏有线	102,400	421,888.00	0.26
124	600270	外运发展	20,000	419,800.00	0.26
125	002019	亿帆医药	39,100	418,370.00	0.25
126	000636	风华高科	38,800	416,712.00	0.25
127	300166	东方国信	40,078	415,208.08	0.25
128	300088	长信科技	99,900	414,585.00	0.25
129	600388	龙净环保	40,800	414,120.00	0.25
130	600737	中粮糖业	56,100	412,896.00	0.25
131	002074	国轩高科	35,600	411,536.00	0.25
132	600266	北京城建	51,618	408,814.56	0.25
133	600008	首创股份	118,500	406,455.00	0.25
134	000488	晨鸣纸业	72,450	406,444.50	0.25
135	002183	怡亚通	80,700	404,307.00	0.25
136	300418	昆仑万维	31,200	401,232.00	0.24
137	600138	中青旅	31,100	400,879.00	0.24
138	000887	中鼎股份	39,500	399,740.00	0.24
139	603369	今世缘	27,500	398,475.00	0.24
140	002589	瑞康医药	56,990	397,220.30	0.24
141	600884	杉杉股份	30,600	395,352.00	0.24
142	000598	兴蓉环境	97,400	392,522.00	0.24
143	000513	丽珠集团	15,602	392,390.30	0.24
144	002583	海能达	49,700	392,133.00	0.24

145	000930	中粮生化	52,800	391,776.00	0.24
146	000988	华工科技	32,800	391,632.00	0.24
147	600511	国药股份	16,800	390,600.00	0.24
148	600500	中化国际	56,900	389,196.00	0.24
149	002353	杰瑞股份	25,900	388,500.00	0.24
150	601718	际华集团	115,600	387,260.00	0.24
151	601000	唐山港	162,346	386,383.48	0.23
152	601106	中国一重	144,200	385,014.00	0.23
153	600409	三友化工	67,300	384,956.00	0.23
154	600039	四川路桥	117,062	383,963.36	0.23
155	000932	华菱钢铁	62,900	381,174.00	0.23
156	600507	方大特钢	38,100	380,619.00	0.23
157	002191	劲嘉股份	48,500	378,785.00	0.23
158	600649	城投控股	69,000	377,430.00	0.23
159	600373	中文传媒	29,000	377,290.00	0.23
160	000732	泰禾集团	26,899	377,123.98	0.23
161	002916	深南电路	4,700	376,799.00	0.23
162	601179	中国西电	112,100	376,656.00	0.23
163	002250	联化科技	39,900	376,257.00	0.23
164	601128	常熟银行	61,000	374,540.00	0.23
165	002371	七星电子	9,915	374,390.40	0.23
166	600729	重庆百货	13,200	373,560.00	0.23
167	600827	百联股份	44,000	371,800.00	0.23
168	600060	海信电器	42,700	370,636.00	0.23
169	000738	中航动控	30,700	370,242.00	0.23
170	600064	南京高科	46,820	368,941.60	0.22
171	002152	广电运通	65,700	368,577.00	0.22
172	603885	吉祥航空	29,400	368,382.00	0.22
173	000559	万向钱潮	71,800	367,616.00	0.22
174	002640	跨境通	34,000	367,200.00	0.22
175	600863	内蒙华电	158,800	366,828.00	0.22
176	000878	云南铜业	46,200	366,366.00	0.22
177	600056	中国医药	28,900	363,273.00	0.22
178	600435	北方导航	48,800	361,608.00	0.22
179	600312	平高电气	44,600	360,368.00	0.22
180	601966	玲珑轮胎	26,300	358,995.00	0.22
181	300182	捷成股份	83,300	357,357.00	0.22
182	002155	湖南黄金	45,504	357,206.40	0.22
183	002273	水晶光电	37,330	356,874.80	0.22

184	002004	华邦健康	77,050	355,200.50	0.22
185	600380	健康元	53,196	354,817.32	0.22
186	600410	华胜天成	60,520	354,647.20	0.22
187	002385	大北农	110,800	354,560.00	0.22
188	600460	士兰微	43,200	350,784.00	0.21
189	000596	古井贡酒	6,500	350,740.00	0.21
190	600418	江淮汽车	72,600	349,206.00	0.21
191	002266	浙富控股	85,680	348,717.60	0.21
192	600848	上海临港	16,800	347,424.00	0.21
193	000667	美好集团	138,700	346,750.00	0.21
194	600125	铁龙物流	49,500	346,500.00	0.21
195	002831	裕同科技	8,600	344,516.00	0.21
196	300133	华策影视	38,300	343,168.00	0.21
197	002603	以岭药业	32,800	343,088.00	0.21
198	600782	新钢股份	67,400	343,066.00	0.21
199	600062	华润双鹤	28,232	341,324.88	0.21
200	600536	中国软件	16,300	341,159.00	0.21
201	000027	深圳能源	64,600	339,150.00	0.21
202	000970	中科三环	46,100	337,913.00	0.21
203	300316	晶盛机电	33,600	336,672.00	0.20
204	600167	联美控股	37,200	336,288.00	0.20
205	000528	柳工	55,399	336,271.93	0.20
206	002244	滨江集团	84,400	335,912.00	0.20
207	002440	闰土股份	37,300	335,700.00	0.20
208	002285	世联行	66,059	335,579.72	0.20
209	000685	中山公用	47,900	335,300.00	0.20
210	002407	多氟多	30,500	334,280.00	0.20
211	300113	顺网科技	26,300	334,273.00	0.20
212	002051	中工国际	30,129	333,829.32	0.20
213	601928	凤凰传媒	42,000	333,480.00	0.20
214	600598	北大荒	38,800	332,128.00	0.20
215	000028	国药一致	8,000	331,520.00	0.20
216	600348	阳泉煤业	65,700	331,128.00	0.20
217	600664	哈药股份	83,526	329,927.70	0.20
218	600026	中远海能	74,259	329,709.96	0.20
219	000807	云铝股份	84,600	328,248.00	0.20
220	600307	酒钢宏兴	171,500	327,565.00	0.20
221	002408	齐翔腾达	47,881	327,506.04	0.20
222	600158	中体产业	36,500	324,485.00	0.20

223	603816	顾家家居	7,200	324,000.00	0.20
224	600717	天津港	45,800	323,806.00	0.20
225	002701	奥瑞金	63,980	323,738.80	0.20
226	002491	通鼎互联	41,000	323,080.00	0.20
227	600037	歌华有线	37,600	322,984.00	0.20
228	300324	旋极信息	56,676	317,952.36	0.19
229	600525	长园集团	72,580	317,900.40	0.19
230	600216	浙江医药	36,500	316,820.00	0.19
231	600563	法拉电子	7,500	316,050.00	0.19
232	002690	美亚光电	14,800	314,944.00	0.19
233	600094	大名城	86,200	314,630.00	0.19
234	601880	大连港	169,240	313,094.00	0.19
235	600970	中材国际	57,000	311,790.00	0.19
236	600582	天地科技	90,700	310,194.00	0.19
237	601231	环旭电子	34,400	309,600.00	0.19
238	600823	世茂股份	82,100	308,696.00	0.19
239	002368	太极股份	13,300	308,560.00	0.19
240	300058	蓝色光标	71,000	308,140.00	0.19
241	002030	达安基因	30,218	307,014.88	0.19
242	600291	西水股份	29,800	306,642.00	0.19
243	300197	铁汉生态	80,750	306,042.50	0.19
244	300459	金科娱乐	41,300	303,555.00	0.18
245	601958	金钼股份	51,000	301,920.00	0.18
246	002672	东江环保	26,250	300,300.00	0.18
247	603883	老百姓	6,359	300,208.39	0.18
248	600120	浙江东方	23,850	299,556.00	0.18
249	300026	红日药业	98,200	299,510.00	0.18
250	603444	吉比特	2,000	296,000.00	0.18
251	002317	众生药业	35,300	294,755.00	0.18
252	000400	许继电气	32,900	292,481.00	0.18
253	600633	浙数文化	35,700	290,955.00	0.18
254	000563	陕国投 A	107,700	288,636.00	0.18
255	000031	中粮地产	58,900	287,432.00	0.17
256	300055	万邦达	37,400	286,858.00	0.17
257	000717	*ST 韶钢	63,000	286,650.00	0.17
258	002414	高德红外	13,300	286,615.00	0.17
259	600171	上海贝岭	30,300	283,002.00	0.17
260	601100	恒立液压	14,200	281,302.00	0.17
261	600597	光明乳业	33,600	280,896.00	0.17

262	600648	外高桥	20,400	280,296.00	0.17
263	300002	神州泰岳	84,800	279,840.00	0.17
264	002400	省广股份	94,279	279,065.84	0.17
265	000543	皖能电力	58,170	278,634.30	0.17
266	600499	科达洁能	68,820	278,032.80	0.17
267	002212	南洋股份	25,000	278,000.00	0.17
268	600901	江苏租赁	47,000	277,770.00	0.17
269	600017	日照港	100,000	276,000.00	0.17
270	002444	巨星科技	29,100	275,868.00	0.17
271	600645	中源协和	16,900	274,456.00	0.17
272	300010	立思辰	37,800	274,428.00	0.17
273	002280	联络互动	70,900	274,383.00	0.17
274	000758	中色股份	74,600	272,290.00	0.17
275	300244	迪安诊断	17,880	271,239.60	0.16
276	601717	郑煤机	48,800	269,864.00	0.16
277	002242	九阳股份	16,826	269,384.26	0.16
278	600179	安通控股	40,320	268,128.00	0.16
279	600503	华丽家族	87,900	268,095.00	0.16
280	002064	华峰氨纶	63,700	266,903.00	0.16
281	002131	利欧股份	181,309	266,524.23	0.16
282	600751	海航科技	98,300	266,393.00	0.16
283	600978	宜华生活	64,900	266,090.00	0.16
284	000006	深振业 A	51,300	265,734.00	0.16
285	600073	上海梅林	35,475	264,288.75	0.16
286	600267	海正药业	31,500	264,285.00	0.16
287	600908	无锡银行	50,400	264,096.00	0.16
288	601127	小康股份	15,400	263,956.00	0.16
289	002366	台海核电	28,100	263,578.00	0.16
290	000718	苏宁环球	82,300	261,714.00	0.16
291	002839	张家港行	48,900	261,615.00	0.16
292	002426	胜利精密	112,000	259,840.00	0.16
293	002563	森马服饰	29,100	259,572.00	0.16
294	600835	上海机电	17,700	257,535.00	0.16
295	000926	福星股份	41,900	256,428.00	0.16
296	000078	海王生物	85,900	255,982.00	0.16
297	000848	承德露露	31,790	255,591.60	0.16
298	002128	露天煤业	35,640	255,182.40	0.16
299	601200	上海环境	19,200	254,784.00	0.15
300	002573	清新环境	35,100	253,422.00	0.15

301	002254	泰和新材	23,340	253,005.60	0.15
302	600098	广州发展	44,500	251,870.00	0.15
303	601678	滨化股份	59,008	249,013.76	0.15
304	600623	华谊集团	30,600	247,248.00	0.15
305	002056	横店东磁	44,700	247,191.00	0.15
306	601608	中信重工	94,900	246,740.00	0.15
307	002028	思源电气	24,920	245,960.40	0.15
308	600557	康缘药业	23,860	245,280.80	0.15
309	600141	兴发集团	23,780	244,696.20	0.15
310	000156	华数传媒	30,800	244,244.00	0.15
311	000877	天山股份	34,300	243,873.00	0.15
312	002807	江阴银行	47,800	242,824.00	0.15
313	300115	长盈精密	29,580	242,260.20	0.15
314	002359	齐星铁塔	29,470	241,948.70	0.15
315	000012	南玻A	60,450	241,195.50	0.15
316	002505	大康农业	148,570	240,683.40	0.15
317	600787	中储股份	48,100	240,500.00	0.15
318	000519	江南红箭	37,962	238,780.98	0.15
319	000564	西安民生	94,200	238,326.00	0.14
320	600611	大众交通	59,700	238,203.00	0.14
321	601326	秦港股份	75,300	236,442.00	0.14
322	300287	飞利信	62,300	235,494.00	0.14
323	300199	翰宇药业	25,201	235,377.34	0.14
324	600869	智慧能源	48,500	235,225.00	0.14
325	000980	金马股份	54,300	235,119.00	0.14
326	601689	拓普集团	15,900	235,002.00	0.14
327	603228	景旺电子	4,700	234,953.00	0.14
328	603658	安图生物	4,800	234,672.00	0.14
329	600316	洪都航空	23,700	234,393.00	0.14
330	000158	常山股份	44,670	233,177.40	0.14
331	600859	王府井	17,160	232,689.60	0.14
332	002745	木林森	20,600	232,574.00	0.14
333	603515	欧普照明	8,320	231,878.40	0.14
334	600750	江中药业	13,640	230,925.20	0.14
335	600694	大商股份	9,500	229,805.00	0.14
336	603766	隆鑫通用	56,150	229,653.50	0.14
337	002431	棕榈股份	64,300	229,551.00	0.14
338	600545	卓郎智能	31,000	229,400.00	0.14
339	000021	深科技	39,800	228,850.00	0.14

340	600575	皖江物流	106,500	226,845.00	0.14
341	600993	马应龙	16,690	223,979.80	0.14
342	600580	卧龙电气	35,500	223,650.00	0.14
343	300159	新研股份	48,400	223,124.00	0.14
344	000712	锦龙股份	24,400	221,552.00	0.13
345	600765	中航重机	29,700	220,968.00	0.13
346	603000	人民网	30,100	219,730.00	0.13
347	600478	科力远	56,304	219,585.60	0.13
348	601801	皖新传媒	32,800	219,104.00	0.13
349	600757	长江传媒	33,400	217,768.00	0.13
350	600169	太原重工	97,500	217,425.00	0.13
351	000537	广宇发展	29,000	217,210.00	0.13
352	000727	华东科技	147,500	216,825.00	0.13
353	000937	冀中能源	57,400	216,398.00	0.13
354	002517	恺英网络	58,300	216,293.00	0.13
355	600151	航天机电	54,600	216,216.00	0.13
356	300308	中际装备	5,300	215,657.00	0.13
357	002332	仙琚制药	34,950	214,243.50	0.13
358	600777	新潮能源	111,600	213,156.00	0.13
359	300376	易事特	50,600	213,026.00	0.13
360	002048	宁波华翔	20,400	212,772.00	0.13
361	002249	大洋电机	64,400	212,520.00	0.13
362	600155	华创阳安	28,200	212,346.00	0.13
363	601016	节能风电	91,000	211,120.00	0.13
364	600338	西藏珠峰	10,700	207,901.00	0.13
365	600614	鹏起科技	57,800	207,502.00	0.13
366	601311	骆驼股份	23,400	206,622.00	0.13
367	600565	迪马股份	79,100	205,660.00	0.13
368	000612	焦作万方	51,800	205,128.00	0.12
369	000723	美锦能源	63,900	205,119.00	0.12
370	002424	贵州百灵	23,100	202,125.00	0.12
371	000426	兴业矿业	40,500	201,690.00	0.12
372	600770	综艺股份	42,800	201,588.00	0.12
373	002002	鸿达兴业	69,908	201,335.04	0.12
374	002544	杰赛科技	18,500	200,170.00	0.12
375	002709	天赐材料	9,200	199,272.00	0.12
376	002093	国脉科技	27,200	198,288.00	0.12
377	600874	创业环保	24,000	198,000.00	0.12
378	000049	德赛电池	6,900	197,892.00	0.12

379	002276	万马股份	39,100	197,064.00	0.12
380	300134	大富科技	20,836	195,858.40	0.12
381	601001	大同煤业	45,800	195,566.00	0.12
382	600329	中新药业	15,700	195,308.00	0.12
383	000501	鄂武商 A	20,570	195,003.60	0.12
384	000600	建投能源	38,800	194,776.00	0.12
385	002233	塔牌集团	19,320	194,359.20	0.12
386	002482	广田集团	33,500	193,965.00	0.12
387	002665	首航节能	69,010	193,918.10	0.12
388	002815	崇达技术	13,200	192,852.00	0.12
389	002434	万里扬	29,200	192,428.00	0.12
390	600366	宁波韵升	38,380	192,283.80	0.12
391	002509	天广中茂	81,100	192,207.00	0.12
392	600594	益佰制药	34,800	192,096.00	0.12
393	000062	深圳华强	11,500	191,590.00	0.12
394	002512	达华智能	35,800	190,098.00	0.12
395	600754	锦江股份	8,800	187,440.00	0.11
396	600416	湘电股份	36,100	186,276.00	0.11
397	300257	开山股份	18,600	185,814.00	0.11
398	600259	广晟有色	8,300	185,588.00	0.11
399	002390	信邦制药	45,300	185,277.00	0.11
400	002375	亚厦股份	36,500	183,960.00	0.11
401	600657	信达地产	46,800	183,924.00	0.11
402	603198	迎驾贡酒	13,000	183,430.00	0.11
403	002635	安洁科技	16,183	183,353.39	0.11
404	600122	宏图高科	50,500	183,315.00	0.11
405	601869	长飞光纤	4,600	182,942.00	0.11
406	000541	佛山照明	35,230	182,491.40	0.11
407	002302	西部建设	20,500	181,220.00	0.11
408	603659	璞泰来	3,800	180,120.00	0.11
409	300266	兴源环境	51,000	180,030.00	0.11
410	000766	通化金马	26,100	179,046.00	0.11
411	000090	天健集团	38,916	179,013.60	0.11
412	000061	农产品	36,700	177,995.00	0.11
413	601003	柳钢股份	27,000	177,390.00	0.11
414	600195	中牧股份	16,540	175,985.60	0.11
415	603233	大参林	4,400	175,384.00	0.11
416	603568	伟明环保	7,650	174,802.50	0.11
417	600759	洲际油气	73,990	174,616.40	0.11

418	002707	众信旅游	27,600	174,432.00	0.11
419	600640	号百控股	17,500	171,675.00	0.10
420	002277	友阿股份	53,900	170,324.00	0.10
421	600086	东方金钰	36,500	168,265.00	0.10
422	600350	山东高速	36,900	168,264.00	0.10
423	002663	普邦园林	67,700	167,219.00	0.10
424	600053	九鼎投资	7,000	164,780.00	0.10
425	603328	依顿电子	16,500	163,350.00	0.10
426	002642	荣之联	25,150	161,966.00	0.10
427	600773	西藏城投	26,900	161,400.00	0.10
428	600748	上实发展	30,220	161,374.80	0.10
429	600240	华业资本	61,900	160,321.00	0.10
430	300297	蓝盾股份	32,000	160,000.00	0.10
431	002354	天神娱乐	30,500	159,820.00	0.10
432	000990	诚志股份	13,300	159,733.00	0.10
433	603806	福斯特	5,950	159,460.00	0.10
434	000552	靖远煤电	62,100	158,976.00	0.10
435	002344	海宁皮城	34,900	158,795.00	0.10
436	000829	天音控股	28,100	157,641.00	0.10
437	600639	浦东金桥	14,000	157,640.00	0.10
438	002503	搜于特	67,060	157,591.00	0.10
439	600006	东风汽车	43,500	156,600.00	0.10
440	002489	浙江永强	58,850	155,364.00	0.09
441	600971	恒源煤电	27,400	154,262.00	0.09
442	603866	桃李面包	3,400	153,544.00	0.09
443	600428	中远海特	46,999	152,746.75	0.09
444	000969	安泰科技	33,500	152,425.00	0.09
445	600058	五矿发展	23,345	151,975.95	0.09
446	002818	富森美	7,200	149,688.00	0.09
447	600458	时代新材	21,800	147,804.00	0.09
448	603888	新华网	11,350	145,734.00	0.09
449	603556	海兴电力	10,890	141,570.00	0.09
450	603377	东方时尚	9,640	140,744.00	0.09
451	000536	华映科技	74,807	139,889.09	0.09
452	600335	国机汽车	22,400	139,776.00	0.08
453	601990	南京证券	16,000	139,200.00	0.08
454	002251	步步高	18,710	138,828.20	0.08
455	601777	力帆股份	36,000	137,160.00	0.08
456	600939	重庆建工	29,700	136,917.00	0.08

457	000587	金洲慈航	57,500	135,125.00	0.08
458	002437	誉衡药业	47,557	133,159.60	0.08
459	603225	新凤鸣	7,000	131,250.00	0.08
460	002308	威创股份	29,400	130,830.00	0.08
461	002477	雏鹰农牧	85,000	127,500.00	0.08
462	600862	中航高科	22,700	127,120.00	0.08
463	600743	华远地产	51,560	124,775.20	0.08
464	002681	奋达科技	33,812	123,751.92	0.08
465	600126	杭钢股份	27,430	123,709.30	0.08
466	002147	新光圆成	39,130	121,303.00	0.07
467	000987	越秀金控	15,200	121,144.00	0.07
468	002588	史丹利	31,100	120,979.00	0.07
469	002118	紫鑫药业	27,698	120,763.28	0.07
470	300156	神雾环保	33,000	119,790.00	0.07
471	603486	科沃斯	2,600	119,678.00	0.07
472	000025	特力A	4,500	119,340.00	0.07
473	002416	爱施德	20,180	118,658.40	0.07
474	600393	粤泰股份	55,500	117,660.00	0.07
475	601019	山东出版	15,000	117,300.00	0.07
476	603868	飞科电器	2,900	110,722.00	0.07
477	002345	潮宏基	24,700	110,409.00	0.07
478	000693	ST华泽	33,300	110,223.00	0.07
479	600996	贵广网络	17,200	109,392.00	0.07
480	002699	美盛文化	19,660	107,736.80	0.07
481	002920	德赛西威	6,200	107,570.00	0.07
482	600184	光电股份	11,000	107,470.00	0.07
483	002041	登海种业	19,050	102,679.50	0.06
484	600687	刚泰控股	24,600	102,090.00	0.06
485	600280	中央商场	31,100	101,075.00	0.06
486	603355	莱克电气	4,600	98,900.00	0.06
487	300291	华录百纳	22,022	97,997.90	0.06
488	603712	七一二	5,500	97,955.00	0.06
489	603056	德邦股份	5,900	97,645.00	0.06
490	603169	兰石重装	22,800	97,356.00	0.06
491	300202	聚龙股份	15,070	97,050.80	0.06
492	601969	海南矿业	21,300	95,424.00	0.06
493	601811	新华文轩	8,700	80,997.00	0.05
494	600618	氯碱化工	12,200	79,178.00	0.05
495	601020	华钰矿业	8,700	73,602.00	0.04

496	603650	彤程新材	3,700	73,371.00	0.04
497	600917	重庆燃气	10,200	72,624.00	0.04
498	000761	本钢板材	20,700	69,552.00	0.04
499	603025	大豪科技	6,172	68,817.80	0.04
500	603877	太平鸟	3,400	63,886.00	0.04
501	603569	长久物流	4,560	49,020.00	0.03

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	603019	中科曙光	1,134,352.00	0.50
2	603899	晨光文具	1,119,399.00	0.49
3	603816	顾家家居	1,006,081.00	0.44
4	603589	口子窖	997,219.00	0.44
5	603883	老百姓	974,239.00	0.43
6	600760	中航沈飞	882,290.00	0.39
7	300347	泰格医药	861,920.00	0.38
8	002129	中环股份	820,202.00	0.36
9	002465	海格通信	818,278.00	0.36
10	603885	吉祥航空	763,316.00	0.33
11	000998	隆平高科	749,225.00	0.33
12	300315	掌趣科技	729,014.00	0.32
13	600258	首旅酒店	728,037.00	0.32
14	000623	吉林敖东	726,856.00	0.32
15	603766	隆鑫通用	722,489.50	0.32
16	300450	先导智能	703,391.00	0.31
17	600699	均胜电子	701,124.00	0.31
18	601005	重庆钢铁	689,972.00	0.30
19	600528	中铁工业	672,082.88	0.29
20	601966	玲珑轮胎	665,514.00	0.29

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	603019	中科曙光	2,250,065.00	0.99
2	002422	科伦药业	1,631,258.00	0.72
3	600516	方大炭素	1,597,720.00	0.70
4	000661	长春高新	1,563,609.50	0.69
5	600176	中国巨石	1,405,536.10	0.62
6	603589	口子窖	1,342,242.50	0.59
7	002405	四维图新	1,335,366.00	0.59
8	000786	北新建材	1,125,552.00	0.49
9	002271	东方雨虹	1,062,539.00	0.47
10	002001	新 和 成	985,210.20	0.43
11	002179	中航光电	934,726.94	0.41
12	000998	隆平高科	922,035.80	0.40
13	603883	老百姓	909,721.85	0.40
14	002050	三花股份	885,644.00	0.39
15	000977	浪潮信息	864,450.00	0.38
16	002311	海大集团	849,922.80	0.37
17	000703	恒逸石化	835,950.24	0.37
18	603816	顾家家居	821,282.00	0.36
19	000050	深天马 A	809,789.00	0.36
20	600346	恒力股份	809,074.00	0.35

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	90,214,161.73
卖出股票收入（成交）总额	79,976,621.24

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	9,474.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	331.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,806.45

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

无。

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
483	381,612.19	181,367,690.00	98.40%	2,950,997.00	1.60%

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	中国银河证券股份有限公司	1,679,613.00	0.91%
2	张红艳	243,300.00	0.13%
3	姜晓平	235,683.00	0.13%
4	李敏慧	231,516.00	0.13%
5	王梅	231,279.00	0.13%
6	中信证券股份有限公司	201,791.00	0.11%
7	孙建兴	183,563.00	0.10%
8	陈妙琴	139,373.00	0.08%
9	陈红兰	130,575.00	0.07%
10	朱庆芳	115,758.00	0.06%
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基	179,486,286.00	97.38%

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	172,318,687.00

本报告期间基金总申购份额	18,000,000.00
减:本报告期间基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	184,318,687.00

§ 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，基金管理人的重大人事变动如下：

(1) 2018年2月10日，本基金管理人发布公告，王文英女士自2018年2月7日起任公司总经理助理；

(2) 2018年3月3日，本基金管理人发布公告，董瑞倩女士自2018年2月28日起任公司固定收益投资总监；

(3) 2018年3月10日，本基金管理人发布公告，张琦先生自2018年3月7日起任公司股票投资总监；

(4) 2018年5月12日，本基金管理人发布公告，王福新先生自2018年5月9日起任公司总经理助理；

(5) 2018年7月14日，本基金管理人发布公告，封雪梅女士因个人原因自2018年7月6日起离任公司总经理助理；

(6) 2018年7月27日，本基金管理人发布公告，王大朋先生自2018年7月25日起任公司总经理助理；

(7) 2018年8月30日，本基金管理人发布公告，石伟先生自2018年8月29日起任公司资产配置总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门聘任刘琳同志、李智同志为托管业务部高级专家。

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，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局《关于对国寿安保基金管理有限公司采取责令改正并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 3 个月。公司高度重视，制定相关整改措施，并持续进行全面整改。公司对行政监管措施决定书指出的问题已整改完毕并向监管部门报告了整改报告，整改已完成验收。本报告期内，基金管理人的高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人的托管业务部门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	
海通证券	2	77,203,238.53	45.77%	71,899.24	50.78%	-
招商证券	2	69,332,318.10	41.11%	50,703.95	35.81%	-
国泰君安	2	14,015,838.98	8.31%	13,053.24	9.22%	-
兴业证券	2	8,117,767.54	4.81%	5,936.90	4.19%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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 500 交易型开放式指数更新招募说明书（摘要）（2018 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 1 月 15 日
2	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 1 月 20 日
3	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（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 3 月 27 日
4	国寿安保基金管理有限公司关于修订公司旗下权益类基金基金合同有关条款的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 3 月 29 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 4 月 20 日
6	国寿安保中证 500 交易型开放式指	中证报、上证报、证	2018 年 7 月 13 日

	数更新招募说明书（摘要）（2018 年第 2 号）	券时报及公司网站	
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 7 月 20 日
8	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年半年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 8 月 24 日
9	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2018 年 10 月 25 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	20180101~20181231	169,486,286.00	14,000,000.00	4,000,000.00	179,486,286.00	97.38%
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.gsfunds.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

2019 年 3 月 30 日