

国寿安保中证 500 交易型开放式 指数证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 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 2020 年 4 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 2019 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	5
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遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人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遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61

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	61
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	61
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	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§9 基金份额持有人信息	63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	63
§10 开放式基金份额变动	64
§11 重大事件揭示	65
11.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	67
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	70
13.3 查阅方式	70

§ 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	交易型开放式
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	636,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相近的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉	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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-20,398,409.40	-23,204,748.30	-12,215,154.18
本期利润	55,523,284.09	-75,924,415.41	5,702,879.68
加权平均基金份额本期利润	0.1150	-0.4292	0.0307
本期加权平均净值利润率	10.80%	-37.98%	2.33%
本期基金份额净值增长率	26.44%	-32.58%	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-656,335,418.05	-233,606,419.74	-144,112,337.65
期末可供分配基金份额利润	-1.0315	-1.2674	-0.8363
期末基金资产净值	717,909,176.40	164,462,919.65	228,040,844.54
期末基金份额净值	1.1282	0.8923	1.3234
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-47.76%	-58.68%	-38.72%

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。

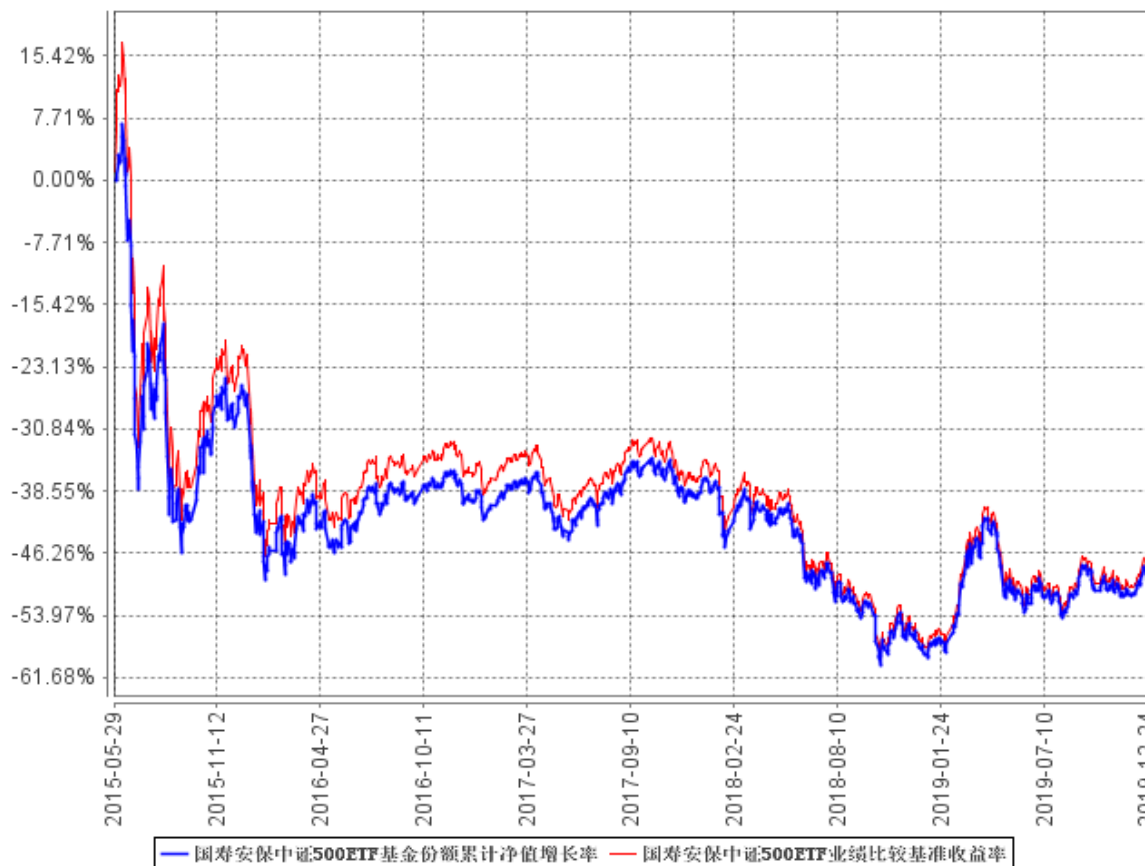
3.2 基金净值表现

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	6.31%	0.91%	6.61%	0.92%	-0.30%	-0.01%
过去六个月	6.33%	1.07%	6.41%	1.08%	-0.08%	-0.01%
过去一年	26.44%	1.46%	26.38%	1.47%	0.06%	-0.01%
过去三年	-13.16%	1.32%	-15.90%	1.33%	2.74%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-47.76%	1.79%	-46.62%	1.83%	-1.14%	-0.04%

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

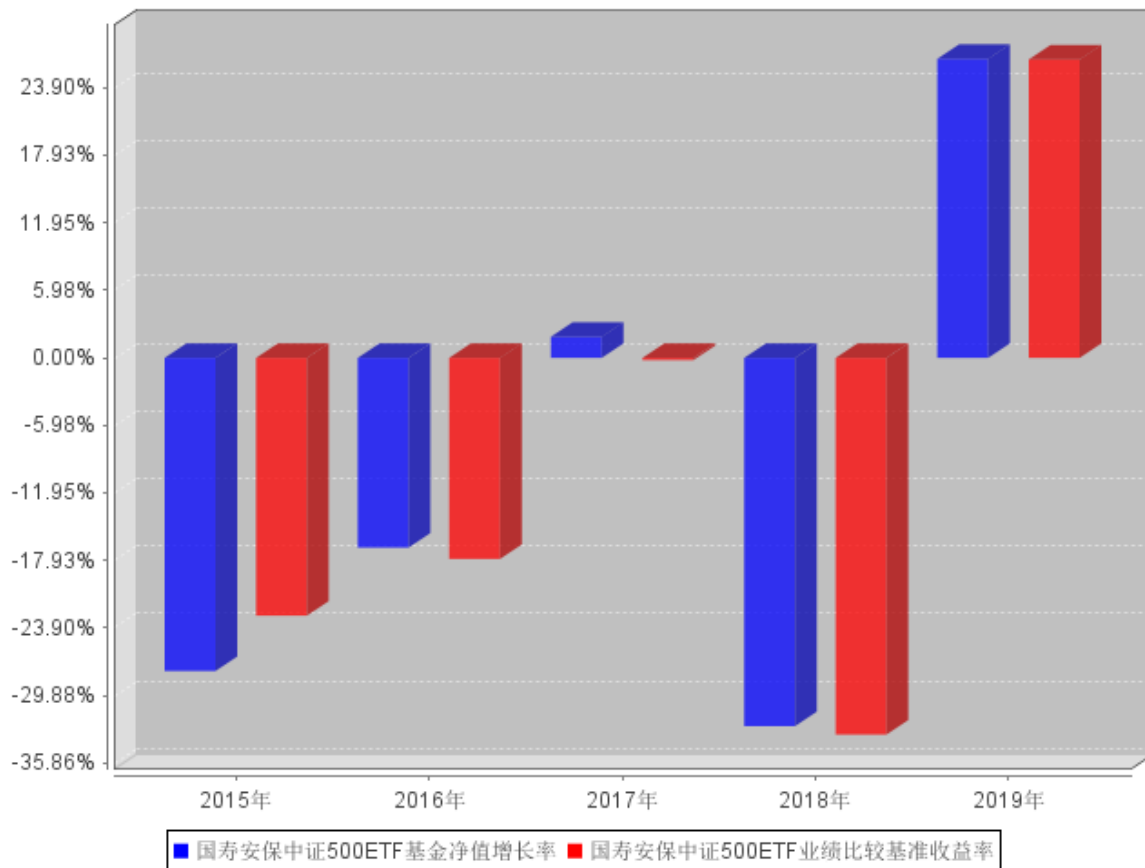
国寿安保中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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（澳大利亚安安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。截至 2019 年 12 月 31 日，公司共管理 53 只公募基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2388.52 亿元，其中公募基金管理规模 1775.76 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	9 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增强型证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金及国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理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 1.1282 元；本报告期基金份额净值增长率为 26.44%，业绩比较基准收益率为 26.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年主流指数均取得不错的收益，沪深 300 上涨 36.07%，中证 500 上涨 26.38%，创业板指上涨 43.79%。经济自去年四季度开始阶段性企稳，但开年遇到的疫情带来短暂的外部冲击，市场波动增大。2020 年是全面建成小康社会和十三五收官之年，预计货币政策继续稳健偏松，财政政策将更加积极，经济调结构同时进行产业升级。资本市场尤其是二级市场是其中的关键一环，科技成长作为产业升级方向得到市场认可，半导体、新能源汽车、5G 和自主可控相关行业得到市场认同，股价表现相对出色。目前主要指数的估值仍然在历史 50%分位数左右甚至更低的位置，市场整体估值相对合理，相比 2019 年以估值修复为主，后续的市场风格将更追求基本面确定性和业绩超预期表现，微观上是细分行业景气度回升和行业竞争格局持续优化。从长期来看，科技成长类股票在长周期跑赢金融地产周期和价值龙头估值持续溢价的趋势已经形成，但结构上可能还存在反复。短期不确定性因素消除后市场回归常态，A 股市场将稳步健康发展，投资机会逐步显现。

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

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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《公开募集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（2020）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 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 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>
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>
<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</p>

	<p>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	吴军 范新紫
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	2020 年 4 月 29 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：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	4,253,270.08	1,372,708.82
结算备付金		-	-
存出保证金		6,567.74	9,474.49
交易性金融资产	7.4.7.2	714,300,817.18	163,576,858.68
其中：股票投资		714,209,817.18	163,576,858.68
基金投资		-	-
债券投资		91,000.00	-
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		99,240.32	-
应收利息	7.4.7.5	935.28	331.96
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		718,660,830.60	164,959,373.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 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		294,715.01	70,357.60
应付托管费		58,942.99	14,071.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	176,342.53	39,598.74
应交税费		0.25	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	221,653.42	370,000.00
负债合计		751,654.20	496,454.30
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,374,244,594.45	398,069,339.39
未分配利润	7.4.7.10	-656,335,418.05	-233,606,419.74
所有者权益合计		717,909,176.40	164,462,919.65
负债和所有者权益总计		718,660,830.60	164,959,373.95

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1282 元，基金份额总额 636,318,687.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		59,919,597.32	-74,025,482.37
1.利息收入		45,014.62	17,010.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	45,002.03	17,010.01
债券利息收入		12.59	-
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）		-17,906,272.11	-21,346,729.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-26,465,138.53	-23,710,537.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,621.15	-
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	8,550,245.27	2,363,808.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	75,921,693.49	-52,719,667.11
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	1,859,161.32	23,904.01
减：二、费用		4,396,313.23	1,898,933.04

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,557,725.47	999,898.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	511,545.00	199,979.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	890,229.22	236,549.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	-
7. 其他费用	7.4.7.20	436,813.50	462,505.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		55,523,284.09	-75,924,415.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		55,523,284.09	-75,924,415.41

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	398,069,339.39	-233,606,419.74	164,462,919.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,523,284.09	55,523,284.09
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）	976,175,255.06	-478,252,282.40	497,922,972.66
其中：1.基金申购款	1,105,756,041.26	-534,050,378.87	571,705,662.39
2.基金赎回款	-129,580,786.20	55,798,096.47	-73,782,689.73
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）	1,374,244,594.45	-656,335,418.05	717,909,176.40
项目	上年度可比期间 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净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	398,069,339.39	-233,606,419.74	164,462,919.65

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>王文英</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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率

与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值；

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

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

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

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

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

期增长率；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

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

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(7) 本基金收益分配采取现金分红；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 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；

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。

7.4.6.3 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	4,253,270.08	1,372,708.82
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：	4,253,270.08	1,372,708.82

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	723,501,211.33	714,209,817.18	-9,291,394.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	91,000.00	91,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	91,000.00	91,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	723,592,211.33	714,300,817.18	-9,291,394.15
项目	上年度末 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

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**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	928.39	327.23
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	3.59	-
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	3.30	4.73
合计	935.28	331.96

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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	176,342.53	39,598.74
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	176,342.53	39,598.74

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018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	170,000.00	320,000.00
应付指数使用费	51,653.42	50,000.00
-	-	-
合计	221,653.42	370,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	184,318,687.00	398,069,339.39
本期申购	512,000,000.00	1,105,756,041.26
本期赎回(以“-”号填列)	-60,000,000.00	-129,580,786.20
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	636,318,687.00	1,374,244,594.45

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	-167,265,768.31	-66,340,651.43	-233,606,419.74
本期利润	-20,398,409.40	75,921,693.49	55,523,284.09
本期基金份额交易产生的变动数	-428,047,119.17	-50,205,163.23	-478,252,282.40
其中：基金申购款	-483,810,245.00	-50,240,133.87	-534,050,378.87
基金赎回款	55,763,125.83	34,970.64	55,798,096.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-615,711,296.88	-40,624,121.17	-656,335,418.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
	活期存款利息收入	38,400.92
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	5,613.47	1,228.16
其他	987.64	144.68

合计	45,002.03	17,010.01
----	-----------	-----------

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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-23,956,510.41	-23,077,581.87
股票投资收益——赎回差价收入	-2,508,628.12	-632,955.86
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-26,465,138.53	-23,710,537.73

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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	244,584,889.91	79,976,621.24
减：卖出股票成本总额	268,541,400.32	103,054,203.11
买卖股票差价收入	-23,956,510.41	-23,077,581.87

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 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年12月31日
赎回基金份额对价总额	73,782,689.73	7,438,637.17
减：现金支付赎回款总额	38,522,559.73	3,970,252.17
减：赎回股票成本总额	37,768,758.12	4,101,340.86
赎回差价收入	-2,508,628.12	-632,955.86

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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑	8,621.15	-

付) 差价收入		
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	8,621.15	-

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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	49,630.50	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	41,000.00	-
减：应收利息总额	9.35	-
买卖债券差价收入	8,621.15	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 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 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
股票投资产生的股利收益	8,550,245.27	2,363,808.45
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	8,550,245.27	2,363,808.45
----	--------------	--------------

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	75,921,693.49	-52,719,667.11
——股票投资	75,921,693.49	-52,719,667.11
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	75,921,693.49	-52,719,667.11

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,859,161.32	-16,095.99
其他	-	40,000.00
合计	1,859,161.32	23,904.01

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
交易所市场交易费用	890,229.22	236,549.81
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	890,229.22	236,549.81

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	150,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
指数使用费	202,354.66	200,000.00
银行费用	4,458.84	2,505.48
其他	-	-
合计	436,813.50	462,505.48

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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	基金托管人
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,557,725.47	999,898.17
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

7.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	511,545.00	199,979.58

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 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。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	4,253,270.08	38,400.92	1,372,708.82	15,637.17

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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（2019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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110065	淮矿转债	2019年12月20日	2020年1月13日	新债流通受限	100.00	100.00	910	91,000.00	91,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

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 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、结算备付金及存出保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资占基金份额比例较低，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 2019 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	4,253,270.08	-	-	-	4,253,270.08
存出保证金	6,567.74	-	-	-	6,567.74

交易性金融资产	91,000.00	-	-	-	714,209,817.18	714,300,817.18
应收证券清算款	-	-	-	-	99,240.32	99,240.32
应收利息	-	-	-	-	935.28	935.28
资产总计	4,350,837.82	-	-	-	714,309,992.78	718,660,830.60
负债	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	294,715.01	294,715.01
应付托管费	-	-	-	-	58,942.99	58,942.99
应付交易费用	-	-	-	-	176,342.53	176,342.53
应交税费	-	-	-	-	0.25	0.25
其他负债	-	-	-	-	221,653.42	221,653.42
负债总计	-	-	-	-	751,654.20	751,654.20
利率敏感度缺口	4,350,837.82	-	-	-	713,558,338.58	717,909,176.40
上年度末 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

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和债券投资等，除此之外的金融资产和金融负债均不计息。因此市场利率的变动对于本资产净值无重大影响。

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。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产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按照法律法规或监管机构的规定执行。于 2019 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 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	714,209,817.18	99.48	163,576,858.68	99.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	91,000.00	0.01	-	-
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	714,300,817.18	99.50	163,576,858.68	99.46

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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	+5%	35,704,941.36	8,169,017.26
-5%	-35,704,941.36	-8,169,017.26	

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 2019 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 714,209,817.18 元（上年度末：162,521,384.68 元），属于第二层次的余额为人民币 91,000.00 元（上年度末：1,055,474.00 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。本基金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 2020 年 4 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	714,209,817.18	99.38
	其中：股票	714,209,817.18	99.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,000.00	0.01
	其中：债券	91,000.00	0.01
	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	4,253,270.08	0.59
8	其他各项资产	106,743.34	0.01
9	合计	718,660,830.60	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	4,806,051.00	0.67
B	采矿业	22,897,012.21	3.19
C	制造业	406,659,652.28	56.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,773,732.80	2.75
E	建筑业	9,312,062.50	1.30
F	批发和零售业	32,856,189.39	4.58
G	交通运输、仓储和邮政业	24,814,665.68	3.46
H	住宿和餐饮业	3,224,797.20	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,384,328.76	10.08
J	金融业	41,721,215.39	5.81
K	房地产业	28,265,756.45	3.94
L	租赁和商务服务业	10,096,752.00	1.41
M	科学研究和技术服务业	4,208,849.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	5,041,358.68	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	714,696.40	0.10
Q	卫生和社会工作	6,204,543.40	0.86
R	文化、体育和娱乐业	13,885,716.84	1.93
S	综合	7,342,437.20	1.02
	合计	714,209,817.18	99.48

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	600745	闻泰科技	69,200	6,401,000.00	0.89
2	000066	长城电脑	291,998	4,543,488.88	0.63
3	002463	沪电股份	200,700	4,457,547.00	0.62
4	002384	东山精密	186,800	4,324,420.00	0.60
5	601099	太平洋	1,132,800	4,293,312.00	0.60
6	601128	常熟银行	455,400	4,148,694.00	0.58
7	600584	长电科技	186,400	4,097,072.00	0.57
8	300014	亿纬锂能	80,400	4,032,864.00	0.56
9	600426	华鲁恒升	189,275	3,760,894.25	0.52
10	300383	光环新网	179,400	3,600,558.00	0.50
11	002371	七星电子	40,815	3,591,720.00	0.50
12	002049	紫光国微	70,600	3,589,304.00	0.50
13	600536	中国软件	49,300	3,534,317.00	0.49
14	002439	启明星辰	104,400	3,528,720.00	0.49
15	300207	欣旺达	180,100	3,515,552.00	0.49
16	600201	生物股份	187,314	3,506,518.08	0.49
17	002812	创新股份	66,930	3,379,965.00	0.47
18	002340	格林美	689,578	3,358,244.86	0.47
19	601872	招商轮船	403,400	3,332,084.00	0.46
20	002465	海格通信	306,400	3,318,312.00	0.46
21	300012	华测检测	220,400	3,286,164.00	0.46
22	600763	通策医疗	32,000	3,280,960.00	0.46
23	002129	中环股份	277,700	3,279,637.00	0.46
24	300253	卫宁健康	218,330	3,270,583.40	0.46
25	002065	东华软件	310,700	3,206,424.00	0.45
26	300088	长信科技	307,400	3,156,998.00	0.44
27	002127	南极电商	285,500	3,114,805.00	0.43

28	600739	辽宁成大	203,500	3,099,305.00	0.43
29	002273	水晶光电	187,429	3,028,852.64	0.42
30	002821	N凯莱英	23,100	2,991,450.00	0.42
31	600801	华新水泥	113,172	2,991,135.96	0.42
32	002353	杰瑞股份	79,700	2,945,712.00	0.41
33	002180	艾派克	88,300	2,906,836.00	0.40
34	002797	第一创业	349,200	2,891,376.00	0.40
35	300315	掌趣科技	458,400	2,828,328.00	0.39
36	000050	深天马 A	170,100	2,770,929.00	0.39
37	601233	桐昆股份	184,200	2,761,158.00	0.38
38	000988	华工科技	133,700	2,712,773.00	0.38
39	000401	冀东水泥	156,900	2,668,869.00	0.37
40	000009	中国宝安	428,680	2,653,529.20	0.37
41	000750	国海证券	490,400	2,618,736.00	0.36
42	600673	东阳光	250,600	2,566,144.00	0.36
43	600885	宏发股份	74,340	2,561,013.00	0.36
44	300285	国瓷材料	112,000	2,559,200.00	0.36
45	000623	吉林敖东	154,600	2,555,538.00	0.36
46	002078	太阳纸业	258,500	2,543,640.00	0.35
47	600298	安琪酵母	82,250	2,522,607.50	0.35
48	002268	卫士通	97,500	2,514,525.00	0.35
49	300529	健帆生物	34,700	2,492,848.00	0.35
50	600150	中国船舶	114,500	2,491,520.00	0.35
51	002195	二三四五	767,185	2,478,007.55	0.35
52	002507	涪陵榨菜	91,900	2,456,487.00	0.34
53	600161	天坛生物	86,874	2,427,259.56	0.34
54	002926	N 华西	218,100	2,401,281.00	0.33
55	600642	申能股份	408,200	2,371,642.00	0.33
56	603517	绝味食品	50,440	2,342,938.00	0.33
57	002500	山西证券	282,100	2,338,609.00	0.33
58	600699	均胜电子	129,660	2,320,914.00	0.32
59	002131	利欧股份	773,809	2,298,212.73	0.32
60	300296	利亚德	295,800	2,268,786.00	0.32
61	300168	万达信息	146,212	2,256,051.16	0.31
62	000998	隆平高科	153,300	2,255,043.00	0.31
63	000975	银泰资源	164,923	2,244,602.03	0.31
64	600256	广汇能源	677,500	2,242,525.00	0.31
65	002373	千方科技	123,600	2,229,744.00	0.31
66	002572	索菲亚	106,200	2,224,890.00	0.31

67	601231	环旭电子	115,100	2,213,373.00	0.31
68	600704	物产中大	420,600	2,208,150.00	0.31
69	600325	华发股份	281,570	2,204,693.10	0.31
70	600909	华安证券	300,900	2,196,570.00	0.31
71	601100	恒立液压	44,100	2,193,975.00	0.31
72	600143	金发科技	299,500	2,180,360.00	0.30
73	601799	星宇股份	22,900	2,175,042.00	0.30
74	000686	东北证券	233,400	2,170,620.00	0.30
75	002387	黑牛食品	136,400	2,168,760.00	0.30
76	600879	航天电子	361,700	2,162,966.00	0.30
77	603444	吉比特	7,200	2,149,128.00	0.30
78	600079	人福医药	157,520	2,128,095.20	0.30
79	600528	中铁工业	184,747	2,124,590.50	0.30
80	600486	扬农化工	30,920	2,122,039.60	0.30
81	002250	联化科技	122,800	2,103,564.00	0.29
82	601168	西部矿业	316,966	2,098,314.92	0.29
83	600132	重庆啤酒	40,200	2,088,792.00	0.29
84	002385	大北农	418,500	2,084,130.00	0.29
85	600728	佳都科技	222,100	2,083,298.00	0.29
86	002013	中航机电	299,900	2,081,306.00	0.29
87	000513	丽珠集团	61,353	2,067,596.10	0.29
88	000999	华润三九	65,200	2,065,536.00	0.29
89	002174	游族网络	88,700	2,064,049.00	0.29
90	600446	金证股份	100,000	2,058,000.00	0.29
91	002670	国盛金控	160,736	2,042,954.56	0.28
92	002223	鱼跃医疗	99,950	2,030,984.00	0.28
93	600460	士兰微	130,900	2,025,023.00	0.28
94	002281	光迅科技	67,600	2,013,128.00	0.28
95	600567	山鹰纸业	533,400	2,010,918.00	0.28
96	002019	亿帆医药	122,800	1,995,500.00	0.28
97	600895	张江高科	128,700	1,970,397.00	0.27
98	603858	步长制药	94,900	1,956,838.00	0.27
99	002092	中泰化学	285,402	1,937,879.58	0.27
100	000778	新兴铸管	464,300	1,936,131.00	0.27
101	000997	新大陆	121,519	1,929,721.72	0.27
102	000878	云南铜业	141,200	1,928,792.00	0.27
103	002074	国轩高科	132,300	1,924,965.00	0.27
104	002152	广电运通	200,200	1,923,922.00	0.27
105	300418	昆仑万维	114,500	1,917,875.00	0.27

106	600572	康恩贝	310,454	1,909,292.10	0.27
107	000547	航天发展	186,800	1,909,096.00	0.27
108	002110	三钢闽光	203,650	1,906,164.00	0.27
109	600521	华海药业	109,900	1,896,874.00	0.26
110	600820	隧道股份	313,600	1,894,144.00	0.26
111	600410	华胜天成	182,720	1,883,843.20	0.26
112	600273	嘉化能源	166,600	1,874,250.00	0.26
113	300058	蓝色光标	331,100	1,870,715.00	0.26
114	000581	威孚高科	97,400	1,855,470.00	0.26
115	300308	中际装备	35,540	1,853,411.00	0.26
116	600497	驰宏锌锗	423,000	1,852,740.00	0.26
117	603659	璞泰来	21,700	1,847,755.00	0.26
118	600845	宝信软件	56,120	1,846,348.00	0.26
119	603939	益丰药房	25,200	1,845,144.00	0.26
120	600466	蓝光发展	250,120	1,843,384.40	0.26
121	002212	南洋股份	96,300	1,830,663.00	0.25
122	601966	玲珑轮胎	79,800	1,829,814.00	0.25
123	600549	厦门钨业	140,300	1,829,512.00	0.25
124	002075	沙钢股份	293,300	1,827,259.00	0.25
125	300166	东方国信	140,378	1,824,914.00	0.25
126	603000	人民网	92,000	1,820,680.00	0.25
127	600260	凯乐科技	132,986	1,804,620.02	0.25
128	601005	重庆钢铁	975,000	1,803,750.00	0.25
129	000830	鲁西化工	170,400	1,790,904.00	0.25
130	600839	四川长虹	613,800	1,786,158.00	0.25
131	000060	中金岭南	415,300	1,785,790.00	0.25
132	300274	阳光电源	169,520	1,785,045.60	0.25
133	300113	顺网科技	69,300	1,780,317.00	0.25
134	000636	风华高科	119,100	1,773,399.00	0.25
135	600884	杉杉股份	130,600	1,764,406.00	0.25
136	002690	美亚光电	44,900	1,755,590.00	0.24
137	600021	上海电力	217,500	1,750,875.00	0.24
138	600415	小商品城	452,200	1,750,014.00	0.24
139	000039	中集集团	177,260	1,740,693.20	0.24
140	000960	锡业股份	166,400	1,737,216.00	0.24
141	600315	上海家化	55,900	1,729,546.00	0.24
142	300251	光线传媒	146,200	1,725,160.00	0.24
143	601333	广深铁路	563,600	1,724,616.00	0.24
144	002217	合力泰	310,700	1,724,385.00	0.24

145	600881	亚泰集团	540,100	1,722,919.00	0.24
146	600376	首开股份	214,500	1,709,565.00	0.24
147	300001	特锐德	99,500	1,709,410.00	0.24
148	601866	中远海发	659,300	1,707,587.00	0.24
149	600258	首旅酒店	82,220	1,694,554.20	0.24
150	600779	水井坊	32,600	1,687,050.00	0.23
151	002807	江阴银行	360,960	1,682,073.60	0.23
152	600875	东方电气	183,000	1,681,770.00	0.23
153	300316	晶盛机电	106,800	1,678,896.00	0.23
154	600380	健康元	161,096	1,667,343.60	0.23
155	002191	劲嘉股份	146,100	1,667,001.00	0.23
156	000089	深圳机场	170,400	1,664,808.00	0.23
157	600160	巨化股份	228,120	1,660,713.60	0.23
158	600811	东方集团	494,030	1,659,940.80	0.23
159	600959	江苏有线	415,600	1,654,088.00	0.23
160	603338	浙江鼎力	23,000	1,644,500.00	0.23
161	600718	东软集团	144,600	1,641,210.00	0.23
162	000690	宝新能源	289,400	1,635,110.00	0.23
163	600155	华创阳安	115,600	1,621,868.00	0.23
164	300115	长盈精密	90,780	1,614,976.20	0.22
165	600776	东方通信	77,500	1,614,325.00	0.22
166	000402	金融街	198,600	1,612,632.00	0.22
167	002368	太极股份	41,300	1,607,396.00	0.22
168	000983	西山煤电	261,800	1,604,834.00	0.22
169	600166	福田汽车	765,100	1,599,059.00	0.22
170	600392	盛和资源	174,995	1,587,204.65	0.22
171	300009	安科生物	104,700	1,579,923.00	0.22
172	600755	厦门国贸	215,200	1,579,568.00	0.22
173	600022	山东钢铁	1,091,670	1,561,088.10	0.22
174	600643	爱建集团	161,850	1,553,760.00	0.22
175	603882	金域医学	30,300	1,551,966.00	0.22
176	600580	卧龙电驱	129,000	1,550,580.00	0.22
177	600094	大名城	264,900	1,549,665.00	0.22
178	000825	太钢不锈	378,600	1,548,474.00	0.22
179	002589	瑞康医药	200,190	1,539,461.10	0.21
180	600373	中文传媒	112,700	1,533,847.00	0.21
181	600754	锦江酒店	53,300	1,530,243.00	0.21
182	000729	燕京啤酒	234,300	1,527,636.00	0.21
183	002085	万丰奥威	218,100	1,526,700.00	0.21

184	600282	南钢股份	441,600	1,523,520.00	0.21
185	600808	马钢股份	496,036	1,522,830.52	0.21
186	000970	中科三环	141,600	1,522,200.00	0.21
187	600266	城建发展	187,482	1,518,604.20	0.21
188	300027	华谊兄弟	325,300	1,506,139.00	0.21
189	600737	中粮糖业	177,700	1,503,342.00	0.21
190	600167	联美控股	114,080	1,501,292.80	0.21
191	600216	浙江医药	112,300	1,499,205.00	0.21
192	002233	塔牌集团	118,820	1,497,132.00	0.21
193	600967	内蒙一机	140,497	1,493,483.11	0.21
194	300010	立思辰	115,500	1,491,105.00	0.21
195	002407	多氟多	113,700	1,490,607.00	0.21
196	002221	东华能源	192,000	1,489,920.00	0.21
197	000021	深科技	122,300	1,489,614.00	0.21
198	603707	健友股份	35,800	1,484,984.00	0.21
199	600171	上海贝岭	93,600	1,474,200.00	0.21
200	603885	吉祥航空	98,000	1,470,000.00	0.20
201	000563	陕国投A	329,400	1,459,242.00	0.20
202	600037	歌华有线	161,900	1,458,719.00	0.20
203	600804	鹏博士	238,200	1,457,784.00	0.20
204	600026	中远海能	227,459	1,451,188.42	0.20
205	601699	潞安环能	199,000	1,444,740.00	0.20
206	600435	北方导航	173,200	1,441,024.00	0.20
207	601098	中南传媒	119,500	1,426,830.00	0.20
208	600777	新潮能源	678,200	1,424,220.00	0.20
209	600060	海信视像	130,500	1,415,925.00	0.20
210	000031	中粮地产	195,800	1,405,844.00	0.20
211	600064	南京高科	143,920	1,403,220.00	0.20
212	601118	海南橡胶	284,500	1,399,740.00	0.19
213	002028	思源电气	101,120	1,392,422.40	0.19
214	603866	桃李面包	32,720	1,388,636.80	0.19
215	000598	兴蓉环境	297,900	1,379,277.00	0.19
216	002372	伟星新材	104,700	1,378,899.00	0.19
217	002317	众生药业	108,300	1,375,410.00	0.19
218	600511	国药股份	50,300	1,372,687.00	0.19
219	300244	迪安诊断	61,980	1,371,617.40	0.19
220	603816	顾家家居	29,960	1,370,070.80	0.19
221	600640	号百控股	53,000	1,367,930.00	0.19
222	002936	郑州银行	292,700	1,361,055.00	0.19

223	600782	新钢股份	265,100	1,359,963.00	0.19
224	000883	湖北能源	324,500	1,353,165.00	0.19
225	002038	双鹭药业	102,400	1,346,560.00	0.19
226	000932	华菱钢铁	280,780	1,342,128.40	0.19
227	000807	云铝股份	260,100	1,336,914.00	0.19
228	600863	内蒙华电	482,800	1,327,700.00	0.18
229	601106	中国一重	456,000	1,326,960.00	0.18
230	603228	景旺电子	30,120	1,319,858.40	0.18
231	002414	高德红外	62,250	1,307,250.00	0.18
232	603077	和邦生物	880,760	1,303,524.80	0.18
233	600409	三友化工	206,000	1,301,920.00	0.18
234	002004	华邦健康	263,350	1,300,949.00	0.18
235	300133	华策影视	175,000	1,295,000.00	0.18
236	600597	光明乳业	101,802	1,291,867.38	0.18
237	601958	金钼股份	161,000	1,289,610.00	0.18
238	002583	海能达	153,000	1,286,730.00	0.18
239	002242	九阳股份	51,126	1,286,330.16	0.18
240	002048	宁波华翔	83,200	1,286,272.00	0.18
241	002440	闰土股份	114,800	1,285,760.00	0.18
242	601000	唐山港	492,546	1,280,619.60	0.18
243	603806	福斯特	25,950	1,261,170.00	0.18
244	300180	华峰超纤	141,600	1,251,744.00	0.17
245	000738	中航动控	95,300	1,245,571.00	0.17
246	600008	首创股份	378,000	1,243,620.00	0.17
247	601179	中国西电	340,800	1,240,512.00	0.17
248	000877	天山股份	104,600	1,239,510.00	0.17
249	300072	三聚环保	195,200	1,233,664.00	0.17
250	000559	万向钱潮	228,900	1,229,193.00	0.17
251	000027	深圳能源	197,800	1,228,338.00	0.17
252	300026	红日药业	349,700	1,227,447.00	0.17
253	601689	拓普集团	70,170	1,223,063.10	0.17
254	603883	老百姓	19,059	1,221,300.72	0.17
255	002064	华峰氨纶	195,100	1,219,375.00	0.17
256	000930	中粮生化	184,200	1,215,720.00	0.17
257	002399	海普瑞	62,300	1,215,473.00	0.17
258	000685	中山公用	147,200	1,212,928.00	0.17
259	600388	龙净环保	124,400	1,212,900.00	0.17
260	600138	中青旅	96,200	1,212,120.00	0.17
261	600729	重庆百货	40,600	1,211,910.00	0.17

262	600507	方大特钢	120,400	1,211,224.00	0.17
263	600039	四川路桥	360,162	1,210,144.32	0.17
264	600970	中材国际	173,500	1,209,295.00	0.17
265	600649	城投控股	210,200	1,202,344.00	0.17
266	600827	百联股份	133,300	1,197,034.00	0.17
267	300182	捷成股份	342,300	1,194,627.00	0.17
268	600500	中化国际	225,120	1,193,136.00	0.17
269	600908	无锡银行	214,900	1,192,695.00	0.17
270	000528	柳 工	171,699	1,191,591.06	0.17
271	601718	际华集团	365,100	1,190,226.00	0.17
272	600633	浙数文化	129,900	1,188,585.00	0.17
273	601228	广州港	308,700	1,182,321.00	0.16
274	000008	神州高铁	323,500	1,174,305.00	0.16
275	000012	南 玻 A	232,575	1,165,200.75	0.16
276	002831	裕同科技	43,820	1,163,421.00	0.16
277	600056	中国医药	88,900	1,160,145.00	0.16
278	600515	海航基础	259,700	1,158,262.00	0.16
279	600120	浙江东方	132,251	1,154,551.23	0.16
280	000090	天健集团	217,271	1,151,536.30	0.16
281	600598	北大荒	118,200	1,151,268.00	0.16
282	000712	锦龙股份	74,600	1,133,920.00	0.16
283	002665	首航节能	337,410	1,133,697.60	0.16
284	600062	华润双鹤	86,832	1,133,157.60	0.16
285	000488	晨鸣纸业	222,050	1,130,234.50	0.16
286	600158	中体产业	112,300	1,126,369.00	0.16
287	000028	国药一致	24,800	1,124,928.00	0.16
288	600823	世茂股份	249,400	1,122,300.00	0.16
289	601717	郑煤机	173,300	1,121,251.00	0.16
290	002056	横店东磁	136,700	1,120,940.00	0.16
291	601598	中国外运	262,100	1,116,546.00	0.16
292	600563	法拉电子	22,500	1,112,625.00	0.15
293	600418	江淮汽车	220,300	1,105,906.00	0.15
294	600348	阳泉煤业	199,900	1,105,447.00	0.15
295	002155	湖南黄金	139,804	1,103,053.56	0.15
296	000887	中鼎股份	121,700	1,101,385.00	0.15
297	000826	启迪桑德	119,000	1,092,420.00	0.15
298	000158	常山股份	159,370	1,086,903.40	0.15
299	002266	浙富控股	263,180	1,084,301.60	0.15
300	000400	许继电气	100,600	1,083,462.00	0.15

301	600648	外高桥	62,100	1,078,677.00	0.15
302	002002	鸿达兴业	258,108	1,073,729.28	0.15
303	601608	中信重工	288,500	1,073,220.00	0.15
304	600307	酒钢宏兴	520,500	1,072,230.00	0.15
305	002030	达安基因	92,818	1,067,407.00	0.15
306	300002	神州泰岳	325,800	1,062,108.00	0.15
307	002408	齐翔腾达	147,581	1,055,204.15	0.15
308	600717	天津港	167,040	1,049,011.20	0.15
309	601880	大连港	514,240	1,043,907.20	0.15
310	000301	东方市场	200,800	1,040,144.00	0.14
311	002183	怡亚通	247,000	1,039,870.00	0.14
312	600277	亿利洁能	227,600	1,037,856.00	0.14
313	002701	奥瑞金	234,980	1,036,261.80	0.14
314	000078	海王生物	275,500	1,027,615.00	0.14
315	600862	中航高科	92,700	1,021,554.00	0.14
316	002244	滨江集团	207,000	1,018,440.00	0.14
317	000732	泰禾集团	165,598	1,018,427.70	0.14
318	000501	鄂武商A	76,670	1,018,177.60	0.14
319	002390	信邦制药	193,900	1,017,975.00	0.14
320	600557	康缘药业	69,060	1,017,944.40	0.14
321	002815	崇达技术	58,700	1,014,923.00	0.14
322	000758	中色股份	229,200	1,003,896.00	0.14
323	000681	视觉中国	58,191	1,003,212.84	0.14
324	002640	跨境通	129,500	999,740.00	0.14
325	002925	盈趣科技	22,700	997,665.00	0.14
326	002203	海亮股份	97,300	997,325.00	0.14
327	000156	华数传媒	95,500	997,020.00	0.14
328	002603	以岭药业	80,100	995,643.00	0.14
329	300134	大富科技	63,836	984,351.12	0.14
330	002280	联络互动	253,400	980,658.00	0.14
331	600291	西水股份	108,900	979,011.00	0.14
332	300324	旋极信息	174,276	975,945.60	0.14
333	000967	盈峰环境	157,700	973,009.00	0.14
334	600195	中牧股份	83,876	968,767.80	0.13
335	601928	凤凰传媒	127,000	966,470.00	0.13
336	000718	苏宁环球	252,300	963,786.00	0.13
337	002444	巨星科技	89,500	961,230.00	0.13
338	600545	卓郎智能	157,400	955,418.00	0.13
339	002635	安洁科技	57,283	954,907.61	0.13

340	000717	*ST 韶钢	201,100	953,214.00	0.13
341	600664	哈药股份	250,126	947,977.54	0.13
342	002302	西部建设	83,900	947,231.00	0.13
343	002426	胜利精密	400,300	944,708.00	0.13
344	002709	天赐材料	45,620	944,334.00	0.13
345	000727	华东科技	451,800	944,262.00	0.13
346	600339	中油工程	278,400	943,776.00	0.13
347	600901	江苏租赁	149,000	941,680.00	0.13
348	601975	招商南油	333,900	938,259.00	0.13
349	000813	德展健康	149,100	937,839.00	0.13
350	603712	七一二	38,600	933,348.00	0.13
351	601611	中国核建	130,900	933,317.00	0.13
352	600316	洪都航空	71,600	932,948.00	0.13
353	000959	首钢股份	263,800	931,214.00	0.13
354	600765	中航重机	90,600	926,838.00	0.13
355	600645	中源协和	54,500	922,685.00	0.13
356	601678	滨化股份	179,708	918,307.88	0.13
357	600748	上实发展	153,320	910,720.80	0.13
358	002249	大洋电机	235,800	910,188.00	0.13
359	000761	本钢板材	231,000	910,140.00	0.13
360	600125	铁龙物流	151,900	908,362.00	0.13
361	600499	科达洁能	209,720	908,087.60	0.13
362	603233	大参林	17,370	907,582.50	0.13
363	600869	智慧能源	184,300	903,070.00	0.13
364	600859	王府井	64,475	902,005.25	0.13
365	600017	日照港	306,800	892,788.00	0.12
366	002839	张家港行	150,200	892,188.00	0.12
367	600835	上海机电	53,700	889,809.00	0.12
368	000987	越秀金控	91,400	883,838.00	0.12
369	000519	江南红箭	115,762	882,106.44	0.12
370	600141	兴发集团	85,580	879,762.40	0.12
371	600582	天地科技	275,100	877,569.00	0.12
372	600751	海航科技	299,374	877,165.82	0.12
373	600312	平高电气	135,400	874,684.00	0.12
374	000543	皖能电力	188,270	873,572.80	0.12
375	600259	广晟有色	25,100	872,727.00	0.12
376	600565	迪马股份	243,000	869,940.00	0.12
377	600073	上海梅林	109,075	869,327.75	0.12
378	002745	木林森	63,800	868,318.00	0.12

379	600478	科力远	192,404	846,577.60	0.12
380	002434	万里扬	89,200	845,616.00	0.12
381	601200	上海环境	75,970	843,267.00	0.12
382	000006	深振业 A	157,100	842,056.00	0.12
383	002419	天虹股份	79,800	841,890.00	0.12
384	002491	通鼎互联	125,900	832,199.00	0.12
385	002920	德赛西威	27,400	831,042.00	0.12
386	002128	露天煤业	95,940	830,840.40	0.12
387	600126	杭钢股份	168,430	823,622.70	0.11
388	600317	营口港	322,700	822,885.00	0.11
389	002051	中工国际	82,229	799,265.88	0.11
390	002505	大康农业	455,970	797,947.50	0.11
391	002118	紫鑫药业	127,698	796,835.52	0.11
392	603198	迎驾贡酒	40,000	796,800.00	0.11
393	002382	蓝帆医疗	64,100	778,174.00	0.11
394	300159	新研股份	198,200	776,944.00	0.11
395	002544	杰赛科技	57,000	776,340.00	0.11
396	002375	亚厦股份	133,600	774,880.00	0.11
397	000848	承德露露	97,690	768,820.30	0.11
398	002285	世联行	203,759	764,096.25	0.11
399	600787	中储股份	146,200	761,702.00	0.11
400	600639	浦东金桥	56,400	761,400.00	0.11
401	000553	沙隆达 A	75,800	758,000.00	0.11
402	601326	秦港股份	237,300	756,987.00	0.11
403	002681	奋达科技	135,312	755,040.96	0.11
404	603328	依顿电子	66,400	751,648.00	0.10
405	300459	金科娱乐	235,507	751,267.33	0.10
406	601139	深圳燃气	95,600	748,548.00	0.10
407	002176	江特电机	198,500	746,360.00	0.10
408	000062	深圳华强	52,210	743,470.40	0.10
409	603888	新华网	34,650	731,115.00	0.10
410	600759	洲际油气	263,290	729,313.30	0.10
411	002470	金正大	273,100	726,446.00	0.10
412	601019	山东出版	104,200	724,190.00	0.10
413	000537	广宇发展	92,900	721,833.00	0.10
414	603568	伟明环保	31,422	720,820.68	0.10
415	600985	淮北矿业	72,100	720,279.00	0.10
416	000564	西安民生	299,600	716,044.00	0.10
417	300197	铁汉生态	233,950	715,887.00	0.10

418	603377	东方时尚	39,140	714,696.40	0.10
419	300376	易事特	154,300	706,694.00	0.10
420	603515	欧普照明	25,120	706,123.20	0.10
421	300297	蓝盾股份	124,600	702,744.00	0.10
422	600770	综艺股份	129,600	698,544.00	0.10
423	002573	清新环境	107,900	695,955.00	0.10
424	002867	周大生	36,300	691,152.00	0.10
425	002093	国脉科技	83,800	675,428.00	0.09
426	600694	大商股份	24,400	668,316.00	0.09
427	600428	中远海特	178,299	666,838.26	0.09
428	601016	节能风电	276,300	665,883.00	0.09
429	600575	淮河能源	258,400	664,088.00	0.09
430	600329	中新药业	47,400	656,964.00	0.09
431	002625	龙生股份	71,500	654,225.00	0.09
432	000869	张裕A	22,700	651,490.00	0.09
433	002358	森源电气	92,700	647,973.00	0.09
434	000937	冀中能源	176,300	645,258.00	0.09
435	603766	隆鑫通用	170,750	636,897.50	0.09
436	000061	农产品	112,800	630,552.00	0.09
437	000766	通化金马	96,300	629,802.00	0.09
438	002416	爱施德	82,280	626,150.80	0.09
439	600757	长江传媒	101,000	622,160.00	0.09
440	300257	开山股份	57,100	621,248.00	0.09
441	000536	华映科技	229,907	620,748.90	0.09
442	600623	华谊集团	92,800	617,120.00	0.09
443	000990	诚志股份	41,600	616,512.00	0.09
444	002503	搜于特	257,060	614,373.40	0.09
445	002424	贵州百灵	70,500	614,055.00	0.09
446	601001	大同煤业	139,100	612,040.00	0.09
447	002672	东江环保	67,850	610,650.00	0.09
448	600006	东风汽车	133,100	609,598.00	0.08
449	000426	兴业矿业	122,100	606,837.00	0.08
450	002366	台海核电	86,600	602,736.00	0.08
451	000980	金马股份	202,400	593,032.00	0.08
452	600098	广州发展	90,600	592,524.00	0.08
453	000600	建投能源	119,200	582,888.00	0.08
454	600058	五矿发展	71,345	572,186.90	0.08
455	600338	西藏珠峰	45,540	569,250.00	0.08
456	603486	科沃斯	28,000	568,120.00	0.08

457	600657	信达地产	142,300	567,777.00	0.08
458	601615	明阳智能	46,000	565,800.00	0.08
459	600903	贵州燃气	37,940	560,753.20	0.08
460	002482	广田集团	127,700	559,326.00	0.08
461	002437	誉衡药业	182,657	553,450.71	0.08
462	600350	山东高速	112,000	549,920.00	0.08
463	002653	海思科	27,000	549,720.00	0.08
464	600053	九鼎投资	21,600	549,288.00	0.08
465	601801	皖新传媒	99,300	544,164.00	0.08
466	002948	青岛银行	91,300	542,322.00	0.08
467	601127	小康股份	47,000	535,800.00	0.07
468	603056	德邦股份	48,000	533,280.00	0.07
469	603556	海兴电力	32,690	532,847.00	0.07
470	600874	创业环保	72,400	520,556.00	0.07
471	600707	彩虹股份	120,200	504,840.00	0.07
472	601003	柳钢股份	85,200	481,380.00	0.07
473	002818	富森美	37,840	478,676.00	0.07
474	601869	长飞光纤	13,500	445,905.00	0.06
475	300199	翰宇药业	76,201	441,965.80	0.06
476	603983	丸美股份	7,200	432,216.00	0.06
477	600996	贵广网络	52,500	422,625.00	0.06
478	600335	国机汽车	72,600	421,080.00	0.06
479	000025	特力A	19,700	417,640.00	0.06
480	603379	三美股份	10,100	377,235.00	0.05
481	601969	海南矿业	65,100	376,929.00	0.05
482	601860	紫金银行	66,800	375,416.00	0.05
483	601811	新华文轩	26,300	346,897.00	0.05
484	603225	新凤鸣	27,940	345,059.00	0.05
485	603317	天味食品	7,600	341,240.00	0.05
486	603650	彤程新材	19,500	339,690.00	0.05
487	603355	莱克电气	13,300	314,811.00	0.04
488	603868	飞科电器	8,000	301,440.00	0.04
489	601865	福莱特	24,800	300,824.00	0.04
490	001872	招商港口	17,300	296,868.00	0.04
491	002423	*ST中特	30,500	296,155.00	0.04
492	603025	大豪科技	30,730	291,013.10	0.04
493	600939	重庆建工	60,400	290,524.00	0.04
494	601068	中铝国际	51,000	282,540.00	0.04
495	603256	宏和科技	15,900	234,843.00	0.03

496	600917	重庆燃气	31,000	225,060.00	0.03
497	002957	科瑞技术	6,800	222,836.00	0.03
498	002941	N新交建	11,800	207,090.00	0.03
499	002946	新乳业	15,600	195,936.00	0.03
500	603877	太平鸟	9,600	146,592.00	0.02
501	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
502	603109	神驰机电	684	18,105.48	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	002405	四维图新	4,629,305.00	2.81
2	300014	亿纬锂能	4,151,791.00	2.52
3	601099	太平洋	4,068,580.00	2.47
4	002013	中航机电	3,706,090.50	2.25
5	002157	正邦科技	3,671,333.00	2.23
6	300347	泰格医药	3,399,673.00	2.07
7	300012	华测检测	3,285,614.00	2.00
8	002065	东华软件	3,259,071.00	1.98
9	002049	紫光国微	3,162,824.00	1.92
10	000860	顺鑫农业	3,095,340.00	1.88
11	000656	金科股份	3,050,935.12	1.86
12	002180	艾派克	3,049,164.00	1.85
13	002384	东山精密	3,035,093.00	1.85
14	002916	深南电路	2,981,700.60	1.81
15	000596	古井贡酒	2,880,660.00	1.75
16	600739	辽宁成大	2,841,408.00	1.73
17	002410	广联达	2,806,078.00	1.71
18	000723	美锦能源	2,804,701.80	1.71
19	002340	格林美	2,776,838.10	1.69
20	002127	南极电商	2,771,291.45	1.69

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	000860	顺鑫农业	4,779,423.60	2.91
2	002405	四维图新	4,720,059.50	2.87
3	600183	生益科技	4,530,682.00	2.75
4	002916	深南电路	4,349,293.80	2.64
5	300347	泰格医药	4,327,246.00	2.63
6	300450	先导智能	4,012,477.18	2.44
7	002410	广联达	3,903,871.00	2.37
8	600872	中炬高新	3,790,605.44	2.30
9	603501	韦尔股份	3,544,728.00	2.16
10	000656	金科股份	3,430,980.00	2.09
11	000596	古井贡酒	3,298,628.00	2.01
12	300146	汤臣倍健	3,148,757.15	1.91
13	002157	正邦科技	3,013,236.00	1.83
14	600600	青岛啤酒	2,978,713.55	1.81
15	002506	协鑫集成	2,919,790.00	1.78
16	603899	晨光文具	2,901,210.56	1.76
17	603369	今世缘	2,849,878.00	1.73
18	600256	广汇能源	2,606,992.50	1.59
19	300413	快乐购	2,552,759.00	1.55
20	002299	圣农发展	2,471,349.00	1.50

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	507,112,751.08
卖出股票收入（成交）总额	244,584,889.91

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	91,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	91,000.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110065	淮矿转债	910	91,000.00	0.01

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 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	6,567.74
2	应收证券清算款	99,240.32
3	应收股利	-
4	应收利息	935.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,743.34

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

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

9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
378	1,683,382.77	633,862,721.00	99.61%	2,455,966.00	0.39%

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	中信证券股份有限公司	376,435.00	0.06%
2	张红艳	243,300.00	0.04%
3	姜晓平	235,683.00	0.04%
4	李敏慧	231,516.00	0.04%
5	孙建兴	183,563.00	0.03%
6	陈妙琴	139,373.00	0.02%
7	陈红兰	130,575.00	0.02%
8	朱庆芳	115,758.00	0.02%
9	郑敏	100,000.00	0.02%
10	李淑清	69,455.00	0.01%
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	633,486,286.00	99.55%

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	184,318,687.00
本报告期期间基金总申购份额	512,000,000.00
减:本报告期期间基金总赎回份额	60,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	636,318,687.00

§ 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，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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	
申万宏源	2	306,720,003.20	41.14%	224,304.35	38.54%	-
中信证券	2	175,338,636.04	23.52%	163,292.38	28.06%	-
长城证券	2	117,427,922.85	15.75%	85,873.94	14.76%	-
招商证券	2	93,053,664.66	12.48%	68,046.23	11.69%	-

太平洋证券	1	29,474,383.10	3.95%	18,607.01	3.20%	-
国泰君安	2	23,483,122.28	3.15%	21,869.97	3.76%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-

中信证券	49,630.50	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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）（2019 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2019 年 1 月 12 日
2	国寿安保中证 500ETF2018 年第 4 季度报告	中证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
3	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年度报告	中证报及公司网站	2019 年 3 月 30 日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中证报及公司网站	2019 年 4 月 22 日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	中证报及公司网站	2019 年 6 月 27 日
6	国寿安保基金管理有限公司新增北京百度百盈基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 7 月 2 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019 年 7 月 3 日
8	国寿安保中证 500ETF 更新招募说明书（摘要）（2019 年第 1 号）	中证报及公司网站	2019 年 7 月 12 日
9	国寿安保基金公司关于旗下基金新增中山证券为销售机构并参加费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019 年 7 月 17 日
10	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中证报及公司网站	2019 年 7 月 18 日
11	国寿安保基金管理有限公司关于	中证报及公司网站	2019 年 7 月 30 日

	旗下部分基金新增联储证券有限责任公司为销售机构的公告		
12	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）	中证报及公司网站	2019 年 8 月 28 日
13	关于旗下基金参加申万宏源、申万宏源西部费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019 年 9 月 17 日
14	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加方德保险代理有限公司费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 10 月 17 日
15	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中证报及公司网站	2019 年 10 月 23 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	20190101~20191231	179,486,286.00	510,000,000.00	56,000,000.00	633,486,286.00	99.55%
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

2020 年 4 月 30 日