

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

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
<b>§5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.8 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	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47

---

<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	48
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 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	624,318,687.00 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
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
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
----------------	-------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 – 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-15,482,688.06
本期利润	11,990,199.29
加权平均基金份额本期利润	0.0370
本期加权平均净值利润率	3.49%
本期基金份额净值增长率	18.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-685,898,009.28
期末可供分配基金份额利润	-1.0986
期末基金资产净值	662,430,427.94
期末基金份额净值	1.0610
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-50.87%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.86%	1.39%	0.78%	1.39%	0.08%	0.00%
过去三个月	-10.63%	1.82%	-10.76%	1.81%	0.13%	0.01%
过去六个月	18.91%	1.78%	18.77%	1.79%	0.14%	-0.01%
过去一年	-4.83%	1.68%	-5.12%	1.69%	0.29%	-0.01%
过去三年	-16.44%	1.30%	-19.16%	1.31%	2.72%	-0.01%
自基金合同	-50.87%	1.87%	-49.84%	1.90%	-1.03%	-0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金的基金合同于2015年5月29日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2015年5月29日至2019年6月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308号文核准，于2013年10月29日设立，公司注册资本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2019年6月30日，公司共管理48只证券投资基金及部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为2,070.27亿元，其中证券投资基金管理规模为1,538.97

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执行交易公平执行，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。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过

该证券当日成交量的 5%的情形。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0610 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.91%，业绩比较基准收益率为 18.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历去年股票市场回调，上半年主流指数均取得不错的反弹。展望 2019 年下半年，我国宏观经济仍处在稳定可控的区间，经济韧性强但仍有下行压力，企业盈利增速仍处于探底的过程中，预期全年 GDP 增速会在 6.3%左右，在主要经济体中增速依然突出。外部因素仍难言乐观，贸易摩擦影响仍然是一个不可忽视的因素，全球经济增速预期下修，全球主要央行纷纷降息开启货币宽松模式刺激经济，加息周期中的美联储也提前降息应对经济下行，预计美国经济有可能将步入缓慢衰退的过程。从国内环境看，社融增速在经历了连续几个季度下降后，目前在 11%左右，处于合理稳定区间。中央再次强调房住不炒，以防止信贷资金大规模流向地产领域，同时加强对小微企业的信贷力度以激发民营经济活力。货币政策保持稳健，财政上继续实施减税降费，稳增长的同时调结构，从传统的刺激基建地产切换到激发民营企业活力、发挥消费的基础性作用、促进创新型企业发展的新增长点上。资本市场方面，明确提出科创板要坚守定位，落实好以信息披露为核心的注册制，提高上市公司质量等举措，都说明资本市场的改革创新和制度完善已经在加速进行，有利于整个资本市场长期向好，主要核心指数的配置价值将逐步显现。

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历。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,120,696.98	1,372,708.82
结算备付金		244,724.35	-
存出保证金		114,557.87	9,474.49
交易性金融资产	6.4.7.2	656,921,035.84	163,576,858.68
其中：股票投资		656,921,035.84	163,576,858.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,025,654.59	-
应收利息	6.4.7.5	893.08	331.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		663,427,562.71	164,959,373.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		—	2,426.44
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		267,499.94	70,357.60
应付托管费		53,499.99	14,071.52
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	392,542.15	39,598.74
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	283,592.69	370,000.00
负债合计		997,134.77	496,454.30
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,348,328,437.22	398,069,339.39
未分配利润	6.4.7.10	-685,898,009.28	-233,606,419.74
所有者权益合计		662,430,427.94	164,462,919.65
负债和所有者权益总计		663,427,562.71	164,959,373.95

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0610 元，基金份额总额 624,318,687.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		13,821,245.70	-35,454,965.82
1.利息收入		18,062.71	7,990.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,062.71	7,990.18
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）		-15,497,340.55	-3,232,817.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-21,275,109.33	-4,725,884.52
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—	—

股利收益	6.4.7.16	5, 777, 768. 78	1, 493, 067. 13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	27, 472, 887. 35	-32, 231, 204. 31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1, 827, 636. 19	1, 065. 70
<b>减：二、费用</b>		1, 831, 046. 41	1, 108, 782. 86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	851, 814. 35	553, 634. 43
2. 托管费	6.4.10.2.2	170, 362. 84	110, 726. 85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	591, 728. 76	139, 253. 51
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	6.4.7.20	217, 140. 46	305, 168. 07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11, 990, 199. 29	-36, 563, 748. 68
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11, 990, 199. 29	-36, 563, 748. 68

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	11, 990, 199. 29	11, 990, 199. 29
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)	950, 259, 097. 83	-464, 281, 788. 83	485, 977, 309. 00
其中：1. 基金申购款	1, 075, 520, 524. 50	-518, 011, 719. 50	557, 508, 805. 00
2. 基金赎回款	-125, 261, 426. 67	53, 729, 930. 67	-71, 531, 496. 00

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）	1,348,328,437.22	-685,898,009.28	662,430,427.94
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
项目	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）	-	-36,563,748.68	-36,563,748.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	12,958,078.61	-5,632,395.68	7,325,682.93
其中：1. 基金申购款	21,596,797.69	-9,052,578.20	12,544,219.49
2. 基金赎回款	-8,638,719.08	3,420,182.52	-5,218,536.56
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）	385,111,260.80	-186,308,482.01	198,802,778.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

王文英

韩占锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

#### 6.4 报表附注

##### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]485 号文《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 22 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永

华明(2015)验字第 61090605\_A04 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 5 月 29 日正式生效,首次设立募集规模为 665,869,631.00 份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。为了更好的跟踪标的指数,基金管理人在本基金基金份额上市前可进行基金份额折算并提前公告。在本基金基金份额上市后,基金管理人也可以根据运作情况决定是否对基金份额进行折算并提前公告,无需召开份额持有人大会。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

##### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税

收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,120,696.98

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：	4,120,696.98

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	714,661,236.13	656,921,035.84	-57,740,200.29
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	714,661,236.13	656,921,035.84	-57,740,200.29

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	731.48
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	110.10
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	51.50
合计	893.08

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	392,542.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	392,542.15

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	233,592.69
应付指数使用费	50,000.00
合计	283,592.69

#### 6.4.7.9 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6月30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	498,000,000.00	1,075,520,524.50
本期赎回(以"-"号填列)	-58,000,000.00	-125,261,426.67
- 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	624,318,687.00	1,348,328,437.22

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-167,265,768.31	-66,340,651.43	-233,606,419.74
本期利润	-15,482,688.06	27,472,887.35	11,990,199.29
本期基金份额交易产生的变动数	-416,560,136.37	-47,721,652.46	-464,281,788.83
其中：基金申购款	-470,408,629.03	-47,603,090.47	-518,011,719.50
基金赎回款	53,848,492.66	-118,561.99	53,729,930.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-599,308,592.74	-86,589,416.54	-685,898,009.28

#### 6.4.7.11 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6月30日
活期存款利息收入	13,635.07
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	4,166.59
其他	261.05
合计	18,062.71

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-18,781,133.51
股票投资收益——赎回差价收入	-2,493,975.82
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-21,275,109.33

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	146,160,105.78
减：卖出股票成本总额	164,941,239.29
买卖股票差价收入	-18,781,133.51

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	71,531,496.00
减：现金支付赎回款总额	37,361,421.00
减：赎回股票成本总额	36,664,050.82
赎回差价收入	-2,493,975.82

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本报告期间无债券投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券产生的收益/损失。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,777,768.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,777,768.78

#### 6.4.7.17 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6月30日
1. 交易性金融资产	27,472,887.35
——股票投资	27,472,887.35
——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	27,472,887.35
----	---------------

#### 6.4.7.18 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	—
替代损益	1,827,636.19
其他	—
合计	1,827,636.19

#### 6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	591,728.76
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	591,728.76

#### 6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,044.72
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行费用	3,547.77
其他	—
合计	217,140.46

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	851,814.35	553,634.43
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	170,362.84	110,726.85
----------------	------------	------------

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	621,486,286.00	99.5500%	179,486,286.00	97.3800%

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	4,120,696.98	13,635.07	2,414,137.35	7,303.43

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13 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、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本

基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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 6.4.12 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 6.4.12.3 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约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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,120,696.98	-	-	-	4,120,696.98
结算备付金	244,724.35	-	-	-	244,724.35
存出保证金	114,557.87	-	-	-	114,557.87
交易性金融资产	-	-	-	656,921,035.84	656,921,035.84
应收证券清算款	-	-	-	2,025,654.59	2,025,654.59
应收利息	-	-	-	893.08	893.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,479,979.20	-	-	658,947,583.51	663,427,562.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	267,499.94	267,499.94
应付托管费	-	-	-	53,499.99	53,499.99
应付交易费用	-	-	-	392,542.15	392,542.15
其他负债	-	-	-	283,592.69	283,592.69
负债总计	-	-	-	997,134.77	997,134.77
利率敏感度缺口	4,479,979.20	-	-	657,950,448.74	662,430,427.94
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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 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	656,921,035.84	99.17	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	-	-	-	-
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	656,921,035.84	99.17	163,576,858.68	99.46

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5, 其他变量不变;		
	用期末时点比较基准浮动 5 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险;		
	Beta 系数是根据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 6 月 30 日 )	上年度末 ( 2018 年 12 月 31 日 )
	+5%	33,025,420.08	8,169,017.26
	-5%	-33,025,420.08	-8,169,017.26

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等, 因其剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

###### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 656,921,035.84 元 (上年度末: 162,521,384.68 元), 无属于第二层次的余额 (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

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

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

##### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	656,921,035.84	99.02
	其中：股票	656,921,035.84	99.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,365,421.33	0.66
8	其他各项资产	2,141,105.54	0.32
9	合计	663,427,562.71	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	7,256,505.00	1.10
B	采矿业	23,181,050.33	3.50
C	制造业	366,601,748.73	55.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,924,113.30	3.16
E	建筑业	11,651,316.05	1.76
F	批发和零售业	34,873,384.44	5.26
G	交通运输、仓储和邮政业	22,190,713.31	3.35
H	住宿和餐饮业	2,519,387.60	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,314,489.65	9.56
J	金融业	29,410,972.40	4.44
K	房地产业	30,486,013.61	4.60
L	租赁和商务服务业	9,020,091.60	1.36
M	科学研究和技术服务业	926,085.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	5,831,841.64	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,166,490.20	0.33
Q	卫生和社会工作	3,928,790.40	0.59
R	文化、体育和娱乐业	13,636,821.58	2.06

S	综合	9,001,221.00	1.36
	合计	656,921,035.84	99.17

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002405	四维图新	270,650	4,357,465.00	0.66
2	000860	顺鑫农业	88,720	4,138,788.00	0.62
3	600872	中炬高新	96,100	4,115,963.00	0.62
4	002157	正邦科技	199,300	3,320,338.00	0.50
5	002049	紫光国微	74,000	3,264,140.00	0.49
6	300253	卫宁健康	221,830	3,145,549.40	0.47
7	600201	生物股份	200,314	3,142,926.66	0.47
8	000066	长城电脑	303,498	3,119,959.44	0.47
9	002195	二三四五	787,985	3,065,261.65	0.46
10	300450	先导智能	90,216	3,031,257.60	0.46
11	600739	辽宁成大	205,900	2,993,786.00	0.45
12	600426	华鲁恒升	196,575	2,921,104.50	0.44
13	002507	涪陵榨菜	94,300	2,876,150.00	0.43
14	002439	启明星辰	106,800	2,872,920.00	0.43
15	002506	协鑫集成	430,000	2,872,400.00	0.43
16	000401	冀东水泥	163,000	2,870,430.00	0.43
17	600763	通策医疗	32,200	2,852,598.00	0.43
18	002463	沪电股份	208,000	2,832,960.00	0.43
19	600642	申能股份	470,700	2,828,907.00	0.43
20	002127	南极电商	250,400	2,814,496.00	0.42
21	002129	中环股份	288,300	2,813,808.00	0.42
22	600536	中国软件	51,600	2,769,372.00	0.42
23	600895	张江高科	134,200	2,753,784.00	0.42
24	600183	生益科技	182,730	2,750,086.50	0.42
25	600298	安琪酵母	85,550	2,705,946.50	0.41
26	000975	银泰资源	202,723	2,673,916.37	0.40
27	002340	格林美	566,878	2,669,995.38	0.40
28	300383	光环新网	159,100	2,668,107.00	0.40
29	002465	海格通信	278,900	2,660,706.00	0.40
30	000623	吉林敖东	160,200	2,625,678.00	0.40

31	002223	鱼跃医疗	104,350	2,569,097.00	0.39
32	000750	国海证券	508,100	2,555,743.00	0.39
33	002268	卫士通	100,300	2,452,335.00	0.37
34	002384	东山精密	166,700	2,428,819.00	0.37
35	603369	今世缘	86,600	2,415,274.00	0.36
36	600801	华新水泥	117,872	2,386,908.00	0.36
37	002500	山西证券	292,700	2,370,870.00	0.36
38	002075	沙钢股份	296,800	2,326,912.00	0.35
39	002926	N华西	220,700	2,317,350.00	0.35
40	600879	航天电子	375,100	2,310,616.00	0.35
41	002385	大北农	433,600	2,293,744.00	0.35
42	600161	天坛生物	90,774	2,292,043.50	0.35
43	000998	隆平高科	158,000	2,287,840.00	0.35
44	002821	N凯莱英	23,300	2,285,264.00	0.34
45	600325	华发股份	292,170	2,281,847.70	0.34
46	600460	士兰微	136,200	2,260,920.00	0.34
47	002797	第一创业	353,300	2,239,922.00	0.34
48	600528	中铁工业	192,047	2,221,983.79	0.34
49	600779	水井坊	43,500	2,210,670.00	0.33
50	000723	美锦能源	211,300	2,208,085.00	0.33
51	002371	七星电子	31,515	2,182,413.75	0.33
52	002373	千方科技	127,600	2,181,960.00	0.33
53	600497	驰宏锌锗	427,900	2,173,732.00	0.33
54	002299	圣农发展	85,700	2,169,924.00	0.33
55	601128	常熟银行	280,800	2,167,776.00	0.33
56	000988	华工科技	136,400	2,157,848.00	0.33
57	000778	新兴铸管	481,500	2,137,860.00	0.32
58	600584	长电科技	166,300	2,136,955.00	0.32
59	600745	闻泰科技	64,200	2,132,724.00	0.32
60	600848	上海临港	68,500	2,132,405.00	0.32
61	000686	东北证券	241,700	2,129,377.00	0.32
62	000997	新大陆	125,719	2,123,393.91	0.32
63	000009	中国宝安	370,900	2,117,839.00	0.32
64	601168	西部矿业	328,366	2,094,975.08	0.32
65	600699	均胜电子	97,400	2,080,464.00	0.31
66	002092	中泰化学	259,202	2,063,247.92	0.31
67	601005	重庆钢铁	1,021,000	2,052,210.00	0.31
68	600820	隧道股份	325,000	2,050,750.00	0.31
69	600410	华胜天成	190,420	2,043,206.60	0.31

70	600673	东阳光	260,200	2,042,570.00	0.31
71	600549	厦门钨业	142,400	2,037,744.00	0.31
72	600572	康恩贝	317,754	2,033,625.60	0.31
73	000060	中金岭南	430,900	2,020,921.00	0.31
74	002572	索菲亚	108,700	2,017,472.00	0.30
75	600875	东方电气	189,800	2,015,676.00	0.30
76	300168	万达信息	155,112	2,011,802.64	0.30
77	600392	盛和资源	181,595	2,008,440.70	0.30
78	600909	华安证券	304,400	1,990,776.00	0.30
79	600376	首开股份	222,900	1,990,497.00	0.30
80	000999	华润三九	67,100	1,968,714.00	0.30
81	000039	中集集团	183,360	1,958,284.80	0.30
82	000960	锡业股份	173,000	1,932,410.00	0.29
83	000690	宝新能源	299,800	1,930,712.00	0.29
84	600718	东软集团	150,000	1,923,000.00	0.29
85	000830	鲁西化工	176,700	1,922,496.00	0.29
86	002353	杰瑞股份	83,000	1,917,300.00	0.29
87	600166	福田汽车	805,100	1,908,087.00	0.29
88	600811	东方集团	512,830	1,907,727.60	0.29
89	600755	厦门国贸	219,200	1,891,696.00	0.29
90	002916	深南电路	18,560	1,891,635.20	0.29
91	600022	山东钢铁	1,132,470	1,891,224.90	0.29
92	002372	伟星新材	108,400	1,886,160.00	0.28
93	600885	宏发股份	77,540	1,884,222.00	0.28
94	002191	劲嘉股份	151,500	1,880,115.00	0.28
95	600839	四川长虹	636,800	1,878,560.00	0.28
96	600567	山鹰纸业	553,000	1,863,610.00	0.28
97	600959	江苏有线	418,700	1,863,215.00	0.28
98	000581	威孚高科	100,200	1,859,712.00	0.28
99	600804	鹏博士	247,100	1,858,192.00	0.28
100	601866	中远海发	682,700	1,856,944.00	0.28
101	000547	航天发展	193,400	1,848,904.00	0.28
102	603444	吉比特	8,800	1,847,648.00	0.28
103	601333	广深铁路	570,200	1,841,746.00	0.28
104	002281	光迅科技	69,300	1,835,064.00	0.28
105	002078	太阳纸业	268,000	1,825,080.00	0.28
106	601872	招商轮船	418,100	1,822,916.00	0.28
107	600881	亚泰集团	559,700	1,819,025.00	0.27
108	600315	上海家化	58,000	1,806,700.00	0.27

109	002387	黑牛食品	137,800	1,798,290.00	0.27
110	600521	华海药业	126,100	1,778,010.00	0.27
111	002074	国轩高科	135,400	1,775,094.00	0.27
112	600808	马钢股份	514,936	1,755,931.76	0.27
113	603939	益丰药房	25,000	1,749,750.00	0.26
114	002217	合力泰	314,200	1,737,526.00	0.26
115	603077	和邦生物	913,060	1,734,814.00	0.26
116	600260	凯乐科技	86,333	1,724,933.34	0.26
117	600079	人福医药	163,820	1,720,110.00	0.26
118	002221	东华能源	199,200	1,715,112.00	0.26
119	603000	人民网	95,300	1,699,199.00	0.26
120	002273	水晶光电	146,330	1,694,501.40	0.26
121	600486	扬农化工	30,920	1,691,324.00	0.26
122	600094	大名城	268,400	1,688,236.00	0.25
123	002670	国盛金控	133,936	1,687,593.60	0.25
124	600037	歌华有线	164,200	1,683,050.00	0.25
125	600160	巨化股份	236,620	1,682,368.20	0.25
126	300009	安科生物	105,800	1,682,220.00	0.25
127	000970	中科三环	147,200	1,670,720.00	0.25
128	300027	华谊兄弟	337,600	1,657,616.00	0.25
129	002038	双鹭药业	70,000	1,649,200.00	0.25
130	000513	丽珠集团	49,502	1,644,951.46	0.25
131	300274	阳光电源	175,920	1,644,852.00	0.25
132	300315	掌趣科技	475,100	1,639,095.00	0.25
133	002002	鸿达兴业	264,608	1,637,923.52	0.25
134	600967	内蒙一机	145,897	1,634,046.40	0.25
135	600643	爱建集团	168,150	1,610,877.00	0.24
136	000729	燕京啤酒	242,600	1,610,864.00	0.24
137	600845	宝信软件	56,420	1,606,841.60	0.24
138	300088	长信科技	317,400	1,606,044.00	0.24
139	002085	万丰奥威	220,500	1,605,240.00	0.24
140	600143	金发科技	327,500	1,604,750.00	0.24
141	000983	西山煤电	264,800	1,604,688.00	0.24
142	600466	蓝光发展	257,520	1,601,774.40	0.24
143	600064	南京高科	149,320	1,599,217.20	0.24
144	601699	潞安环能	201,200	1,597,528.00	0.24
145	600737	中粮糖业	184,000	1,597,120.00	0.24
146	600388	龙净环保	128,900	1,597,071.00	0.24
147	600435	北方导航	177,600	1,596,624.00	0.24

148	002110	三钢闽光	169,550	1,576,815.00	0.24
149	600266	北京城建	195,182	1,573,166.92	0.24
150	600863	内蒙华电	500,700	1,572,198.00	0.24
151	000089	深圳机场	176,700	1,570,863.00	0.24
152	300166	东方国信	127,278	1,564,246.62	0.24
153	600021	上海电力	180,200	1,564,136.00	0.24
154	002607	亚夏汽车	113,900	1,563,847.00	0.24
155	601098	中南传媒	123,700	1,563,568.00	0.24
156	600171	上海贝岭	96,200	1,563,250.00	0.24
157	000878	云南铜业	146,600	1,558,358.00	0.24
158	002589	瑞康医药	205,290	1,558,151.10	0.24
159	002174	游族网络	91,900	1,551,272.00	0.23
160	300001	特锐德	86,000	1,549,720.00	0.23
161	002690	美亚光电	47,200	1,538,720.00	0.23
162	600026	中远海能	235,959	1,531,373.91	0.23
163	002019	亿帆医药	124,800	1,528,800.00	0.23
164	002131	利欧股份	798,209	1,524,579.19	0.23
165	600258	首旅酒店	84,620	1,521,467.60	0.23
166	000563	陕国投A	341,900	1,518,036.00	0.23
167	600282	南钢股份	432,600	1,514,100.00	0.23
168	603517	绝味食品	38,540	1,499,591.40	0.23
169	300207	欣旺达	130,100	1,498,752.00	0.23
170	000636	风华高科	123,300	1,491,930.00	0.23
171	601106	中国一重	472,500	1,483,650.00	0.22
172	002440	闰土股份	119,000	1,482,740.00	0.22
173	601118	海南橡胶	287,800	1,482,170.00	0.22
174	601718	际华集团	378,600	1,480,326.00	0.22
175	600373	中文传媒	116,700	1,465,752.00	0.22
176	002155	湖南黄金	145,204	1,462,204.28	0.22
177	601100	恒立液压	46,400	1,456,032.00	0.22
178	600380	健康元	167,396	1,447,975.40	0.22
179	000930	中粮生化	191,400	1,439,328.00	0.22
180	000883	湖北能源	328,300	1,424,822.00	0.22
181	002152	广电运通	207,700	1,422,745.00	0.21
182	000732	泰禾集团	85,899	1,417,333.50	0.21
183	000559	万向钱潮	237,000	1,417,260.00	0.21
184	601966	玲珑轮胎	83,300	1,416,100.00	0.21
185	000826	启迪桑德	120,100	1,415,979.00	0.21
186	300316	晶盛机电	111,200	1,411,128.00	0.21

187	002250	联化科技	127,200	1,410,648.00	0.21
188	600649	城投控股	218,000	1,410,460.00	0.21
189	000598	兴蓉环境	309,600	1,408,680.00	0.21
190	601000	唐山港	511,046	1,405,376.50	0.21
191	000932	华菱钢铁	290,880	1,387,497.60	0.21
192	000681	视觉中国	71,591	1,387,433.58	0.21
193	002233	塔牌集团	118,620	1,385,481.60	0.21
194	600008	首创股份	391,500	1,378,080.00	0.21
195	600827	百联股份	138,800	1,361,628.00	0.21
196	600039	四川路桥	373,562	1,359,765.68	0.21
197	601231	环旭电子	112,700	1,358,035.00	0.21
198	600782	新钢股份	271,200	1,356,000.00	0.20
199	600648	外高桥	64,600	1,355,308.00	0.20
200	300182	捷成股份	307,300	1,355,193.00	0.20
201	002399	海普瑞	64,400	1,351,756.00	0.20
202	600500	中化国际	179,400	1,340,118.00	0.20
203	002583	海能达	158,000	1,325,620.00	0.20
204	600598	北大荒	122,700	1,316,571.00	0.20
205	002004	华邦健康	270,350	1,313,901.00	0.20
206	000738	中航动控	97,900	1,311,860.00	0.20
207	601179	中国西电	353,500	1,307,950.00	0.20
208	000758	中色股份	237,700	1,304,973.00	0.20
209	000031	中粮地产	203,100	1,303,902.00	0.20
210	000685	中山公用	152,400	1,301,496.00	0.20
211	600515	海航基础	262,700	1,300,365.00	0.20
212	002266	浙富控股	272,680	1,295,230.00	0.20
213	601608	中信重工	298,900	1,291,248.00	0.19
214	600167	联美控股	121,180	1,282,084.40	0.19
215	002368	太极股份	42,200	1,278,660.00	0.19
216	000008	神州高铁	339,100	1,278,407.00	0.19
217	600748	上实发展	153,820	1,275,167.80	0.19
218	000027	深圳能源	205,100	1,271,620.00	0.19
219	300418	昆仑万维	98,600	1,268,982.00	0.19
220	000877	天山股份	108,900	1,265,418.00	0.19
221	000807	云铝股份	269,600	1,264,424.00	0.19
222	601678	滨化股份	186,108	1,258,090.08	0.19
223	300058	蓝色光标	294,600	1,257,942.00	0.19
224	603501	韦尔股份	22,900	1,257,439.00	0.19
225	600120	浙江东方	98,665	1,256,992.10	0.19

226	600138	中青旅	99,000	1,256,310.00	0.19
227	603228	景旺电子	31,220	1,249,112.20	0.19
228	600729	重庆百货	41,300	1,248,912.00	0.19
229	600633	浙数文化	133,200	1,245,420.00	0.19
230	600056	中国医药	92,000	1,241,080.00	0.19
231	000488	晨鸣纸业	230,650	1,236,284.00	0.19
232	002183	怡亚通	256,600	1,223,982.00	0.18
233	002414	高德红外	63,650	1,222,080.00	0.18
234	600507	方大特钢	124,900	1,221,522.00	0.18
235	600511	国药股份	53,100	1,219,707.00	0.18
236	603885	吉祥航空	93,000	1,218,300.00	0.18
237	600155	华创阳安	90,200	1,211,386.00	0.18
238	002603	以岭药业	104,500	1,210,110.00	0.18
239	000887	中鼎股份	126,100	1,209,299.00	0.18
240	600409	三友化工	213,100	1,206,146.00	0.18
241	600348	阳泉煤业	207,200	1,203,832.00	0.18
242	300133	华策影视	178,500	1,201,305.00	0.18
243	600216	浙江医药	116,700	1,195,008.00	0.18
244	600823	世茂股份	258,800	1,193,068.00	0.18
245	600158	中体产业	116,500	1,191,795.00	0.18
246	603883	老百姓	20,359	1,190,594.32	0.18
247	002408	齐翔腾达	152,981	1,185,602.75	0.18
248	000528	柳工	177,999	1,185,473.34	0.18
249	600777	新潮能源	569,500	1,184,560.00	0.18
250	600418	江淮汽车	229,000	1,181,640.00	0.18
251	600525	长园集团	186,180	1,176,657.60	0.18
252	000813	德展健康	154,300	1,175,766.00	0.18
253	600060	海信电器	136,100	1,173,182.00	0.18
254	600970	中材国际	180,100	1,158,043.00	0.17
255	600277	亿利洁能	235,600	1,147,372.00	0.17
256	300113	顺网科技	72,900	1,143,072.00	0.17
257	600597	光明乳业	106,202	1,141,671.50	0.17
258	601880	大连港	533,140	1,135,588.20	0.17
259	600062	华润双鹤	89,932	1,134,042.52	0.17
260	300010	立思辰	119,700	1,123,983.00	0.17
261	002701	奥瑞金	240,580	1,123,508.60	0.17
262	601958	金钼股份	167,100	1,119,570.00	0.17
263	002407	多氟多	94,400	1,117,696.00	0.17
264	002812	创新股份	23,900	1,117,325.00	0.17

265	600717	天津港	173,640	1,114,768.80	0.17
266	600478	科力远	199,404	1,114,668.36	0.17
267	000301	东方市场	203,000	1,114,470.00	0.17
268	600580	卧龙电驱	132,300	1,112,643.00	0.17
269	002244	滨江集团	268,000	1,112,200.00	0.17
270	002242	九阳股份	53,226	1,107,633.06	0.17
271	002640	跨境通	132,400	1,102,892.00	0.17
272	002212	南洋股份	80,400	1,101,480.00	0.17
273	600307	酒钢宏兴	540,300	1,096,809.00	0.17
274	000028	国药一致	26,200	1,095,946.00	0.17
275	000090	天健集团	220,371	1,088,632.74	0.16
276	600312	平高电气	140,600	1,081,214.00	0.16
277	000156	华数传媒	98,200	1,081,182.00	0.16
278	600664	哈药股份	261,126	1,081,061.64	0.16
279	002056	横店东磁	141,900	1,078,440.00	0.16
280	600557	康缘药业	72,460	1,076,755.60	0.16
281	300244	迪安诊断	63,380	1,076,192.40	0.16
282	300002	神州泰岳	270,300	1,075,794.00	0.16
283	300026	红日药业	311,800	1,075,710.00	0.16
284	601200	上海环境	78,770	1,072,059.70	0.16
285	600316	洪都航空	74,800	1,070,388.00	0.16
286	600259	广晟有色	26,500	1,067,950.00	0.16
287	601928	凤凰传媒	131,700	1,062,819.00	0.16
288	002128	露天煤业	122,440	1,059,106.00	0.16
289	002491	通鼎互联	130,600	1,056,554.00	0.16
290	002426	胜利精密	410,500	1,050,880.00	0.16
291	002419	天虹股份	80,400	1,050,024.00	0.16
292	603659	璞泰来	22,200	1,043,844.00	0.16
293	600759	洲际油气	270,090	1,042,547.40	0.16
294	600073	上海梅林	113,275	1,042,130.00	0.16
295	002470	金正大	283,700	1,032,668.00	0.16
296	002030	达安基因	96,118	1,031,346.14	0.16
297	600884	杉杉股份	96,800	1,030,920.00	0.16
298	601611	中国核建	132,200	1,028,516.00	0.16
299	000021	深科技	126,500	1,028,445.00	0.16
300	300324	旋极信息	177,276	1,026,428.04	0.15
301	300134	大富科技	65,736	1,020,880.08	0.15
302	002064	华峰氨纶	202,600	1,017,052.00	0.15
303	002665	首航节能	299,710	1,016,016.90	0.15

304	600125	铁龙物流	157,300	1,014,585.00	0.15
305	002176	江特电机	208,000	1,012,960.00	0.15
306	601717	郑煤机	177,200	1,011,812.00	0.15
307	603816	顾家家居	31,560	1,007,395.20	0.15
308	600859	王府井	66,075	1,003,679.25	0.15
309	300197	铁汉生态	279,350	1,002,866.50	0.15
310	600017	日照港	318,300	1,002,645.00	0.15
311	000712	锦龙股份	77,800	998,952.00	0.15
312	600754	锦江股份	40,500	997,920.00	0.15
313	600267	海正药业	99,000	990,000.00	0.15
314	000078	海王生物	284,300	989,364.00	0.15
315	600751	海航科技	311,074	989,215.32	0.15
316	600582	天地科技	285,900	986,355.00	0.15
317	300115	长盈精密	93,880	984,801.20	0.15
318	600563	法拉电子	23,900	983,963.00	0.15
319	600575	皖江物流	335,300	982,429.00	0.15
320	002051	中工国际	85,529	981,017.63	0.15
321	000727	华东科技	468,500	979,165.00	0.15
322	002358	森源电气	96,200	976,430.00	0.15
323	002317	众生药业	112,500	957,375.00	0.14
324	603866	桃李面包	22,920	954,618.00	0.14
325	002285	世联行	211,159	952,327.09	0.14
326	002280	联络互动	260,000	951,600.00	0.14
327	600499	科达洁能	217,220	951,423.60	0.14
328	000400	许继电气	105,000	951,300.00	0.14
329	002302	西部建设	85,200	949,128.00	0.14
330	002424	贵州百灵	95,800	946,504.00	0.14
331	600291	西水股份	94,000	945,640.00	0.14
332	600565	迪马股份	252,200	940,706.00	0.14
333	000959	首钢股份	266,800	939,136.00	0.14
334	600901	江苏租赁	154,200	939,078.00	0.14
335	002505	大康农业	472,470	930,765.90	0.14
336	000519	江南红箭	120,262	929,625.26	0.14
337	600835	上海机电	56,000	929,600.00	0.14
338	002444	巨星科技	92,800	926,144.00	0.14
339	600645	中源协和	53,500	926,085.00	0.14
340	600993	马应龙	52,390	924,683.50	0.14
341	000717	*ST韶钢	208,600	924,098.00	0.14
342	000926	福星股份	133,200	921,744.00	0.14

343	000158	常山股份	168,970	915,817.40	0.14
344	002028	思源电气	91,020	906,559.20	0.14
345	000718	苏宁环球	261,700	905,482.00	0.14
346	600770	综艺股份	135,100	902,468.00	0.14
347	002573	清新环境	112,100	902,405.00	0.14
348	600317	营口港	326,700	901,692.00	0.14
349	002390	信邦制药	170,300	897,481.00	0.14
350	600908	无锡银行	159,100	897,324.00	0.14
351	600141	兴发集团	87,180	896,210.40	0.14
352	002831	裕同科技	46,720	895,622.40	0.14
353	600151	航天机电	173,400	893,010.00	0.13
354	000006	深振业A	163,600	891,620.00	0.13
355	601326	秦港股份	245,600	891,528.00	0.13
356	002249	大洋电机	204,400	887,096.00	0.13
357	000012	南玻A	211,475	879,736.00	0.13
358	600611	大众交通	189,000	878,850.00	0.13
359	002839	张家港行	155,600	876,028.00	0.13
360	002807	江阴银行	186,860	874,504.80	0.13
361	000543	皖能电力	184,870	870,737.70	0.13
362	000980	金马股份	206,800	870,628.00	0.13
363	600787	中储股份	151,600	868,668.00	0.13
364	300308	中际装备	25,540	868,104.60	0.13
365	600765	中航重机	93,900	866,697.00	0.13
366	603515	欧普照明	26,520	855,270.00	0.13
367	603233	大参林	18,970	853,650.00	0.13
368	300055	万邦达	119,500	852,035.00	0.13
369	002332	仙琚制药	125,350	847,366.00	0.13
370	600458	时代新材	81,500	846,785.00	0.13
371	000848	承德露露	101,390	844,578.70	0.13
372	600862	中航高科	93,700	842,363.00	0.13
373	002366	台海核电	89,700	839,592.00	0.13
374	000600	建投能源	123,600	828,120.00	0.13
375	600169	太原重工	309,800	827,166.00	0.12
376	603712	七一二	38,600	819,478.00	0.12
377	002672	东江环保	72,150	818,181.00	0.12
378	600338	西藏珠峰	46,740	817,015.20	0.12
379	600393	粤泰股份	175,000	813,750.00	0.12
379	601311	骆驼股份	75,000	813,750.00	0.12
380	000564	西安民生	310,900	811,449.00	0.12

381	002431	棕榈股份	205,300	810,935.00	0.12
382	002093	国脉科技	86,900	807,301.00	0.12
383	601019	山东出版	103,700	806,786.00	0.12
384	002635	安洁科技	59,583	803,774.67	0.12
385	002048	宁波华翔	74,200	802,844.00	0.12
386	300376	易事特	160,600	791,758.00	0.12
387	300287	飞利信	198,300	787,251.00	0.12
388	002254	泰和新材	74,240	785,459.20	0.12
389	601689	拓普集团	50,600	775,192.00	0.12
390	600978	宜华生活	204,500	768,920.00	0.12
391	002544	杰赛科技	59,100	768,300.00	0.12
392	300159	新研股份	154,000	766,920.00	0.12
393	002745	木林森	65,400	766,488.00	0.12
394	300297	蓝盾股份	126,800	764,604.00	0.12
395	601016	节能风电	286,900	763,154.00	0.12
396	603766	隆鑫通用	177,150	742,258.50	0.11
397	300266	兴源环境	162,700	738,658.00	0.11
398	600640	号百控股	55,200	738,576.00	0.11
399	300199	翰宇药业	80,401	737,277.17	0.11
400	600006	东风汽车	138,200	736,606.00	0.11
401	000869	张 裕A	22,900	735,548.00	0.11
402	600623	华谊集团	96,100	734,204.00	0.11
403	603198	迎驾贡酒	40,500	725,355.00	0.11
404	600195	中牧股份	52,340	724,909.00	0.11
405	002503	搜于特	262,060	720,665.00	0.11
406	600694	大商股份	25,800	720,078.00	0.11
407	600639	浦东金桥	44,500	719,565.00	0.11
408	002709	天赐材料	29,700	718,740.00	0.11
409	600757	长江传媒	105,400	717,774.00	0.11
410	600329	中新药业	49,700	710,213.00	0.11
411	000062	深圳华强	53,410	709,818.90	0.11
412	000501	鄂武商A	65,870	708,102.50	0.11
413	000937	冀中能源	182,500	704,450.00	0.11
414	603888	新华网	35,150	701,594.00	0.11
415	603568	伟明环保	32,522	699,873.44	0.11
416	600750	江中药业	53,475	695,709.75	0.11
417	000990	诚志股份	42,300	694,143.00	0.10
418	600869	智慧能源	153,000	691,560.00	0.10
419	600545	卓郎智能	97,200	691,092.00	0.10

420	000426	兴业矿业	128,500	690,045.00	0.10
421	600416	湘电股份	114,500	689,290.00	0.10
422	603806	福斯特	18,750	688,687.50	0.10
423	002375	亚厦股份	115,600	683,196.00	0.10
424	603056	德邦股份	47,600	670,208.00	0.10
425	002382	蓝帆医疗	48,400	668,888.00	0.10
426	601001	大同煤业	144,700	661,279.00	0.10
427	000537	广宇发展	95,500	660,860.00	0.10
428	002815	崇达技术	42,200	657,898.00	0.10
429	300257	开山股份	59,200	655,936.00	0.10
430	601127	小康股份	49,300	645,830.00	0.10
431	002707	众信旅游	105,300	639,171.00	0.10
432	000061	农产品	117,200	635,224.00	0.10
433	600058	五矿发展	74,745	631,595.25	0.10
434	002920	德赛西威	28,100	629,440.00	0.10
435	002434	万里扬	92,500	628,075.00	0.09
436	600874	创业环保	75,600	626,724.00	0.09
437	002489	浙江永强	187,150	625,081.00	0.09
438	601801	皖新传媒	103,700	623,237.00	0.09
439	000829	天音控股	105,700	615,174.00	0.09
440	002509	天广中茂	297,800	613,468.00	0.09
441	600657	信达地产	147,700	608,524.00	0.09
442	600971	恒源煤电	103,520	605,592.00	0.09
443	600707	彩虹股份	120,500	603,705.00	0.09
444	603377	东方时尚	39,440	602,643.20	0.09
445	600098	广州发展	97,600	601,216.00	0.09
446	000536	华映科技	238,407	600,785.64	0.09
447	002437	誉衡药业	152,057	600,625.15	0.09
448	300459	金科娱乐	104,900	596,881.00	0.09
449	002512	达华智能	132,000	596,640.00	0.09
450	002118	紫鑫药业	88,398	595,802.52	0.09
451	002681	奋达科技	140,012	593,650.88	0.09
452	002948	青岛银行	92,100	592,203.00	0.09
453	600996	贵广网络	54,800	590,744.00	0.09
454	002517	恺英网络	185,100	590,469.00	0.09
455	000541	佛山照明	111,730	585,465.20	0.09
456	002251	步步高	73,010	581,889.70	0.09
457	000766	通化金马	83,800	569,840.00	0.09
458	600350	山东高速	116,400	558,720.00	0.08

459	601139	深圳燃气	96,600	549,654.00	0.08
460	600428	中远海特	148,299	548,706.30	0.08
461	601869	长飞光纤	14,600	547,500.00	0.08
462	000552	靖远煤电	197,700	535,767.00	0.08
463	603328	依顿电子	51,900	533,013.00	0.08
464	600053	九鼎投资	22,700	528,910.00	0.08
465	600335	国机汽车	76,000	525,920.00	0.08
466	002936	郑州银行	103,300	524,764.00	0.08
467	002482	广田集团	106,400	517,104.00	0.08
468	002344	海宁皮城	110,900	516,794.00	0.08
469	601003	柳钢股份	88,500	512,415.00	0.08
470	002818	富森美	39,640	508,581.20	0.08
471	601615	明阳智能	46,300	501,892.00	0.08
472	600903	贵州燃气	38,140	496,964.20	0.08
473	601777	力帆股份	113,800	488,202.00	0.07
474	000587	金洲慈航	183,100	472,398.00	0.07
475	603556	海兴电力	33,590	464,213.80	0.07
476	600939	重庆建工	93,900	459,171.00	0.07
477	000987	越秀金控	48,100	433,862.00	0.07
478	000025	特力A	21,100	426,642.00	0.06
479	002416	爱施德	63,980	399,875.00	0.06
480	600126	杭钢股份	87,530	399,136.80	0.06
481	601969	海南矿业	66,700	392,196.00	0.06
482	002699	美盛文化	62,860	377,160.00	0.06
483	600179	ST安通	127,920	374,805.60	0.06
484	600985	淮北矿业	32,600	369,684.00	0.06
485	603486	科沃斯	12,200	369,050.00	0.06
486	603225	新凤鸣	29,040	362,709.60	0.05
487	603868	飞科电器	9,100	356,265.00	0.05
488	601068	中铝国际	51,500	355,350.00	0.05
489	600280	中央商场	98,400	353,256.00	0.05
490	601811	新华文轩	27,600	336,996.00	0.05
491	603355	莱克电气	14,600	314,192.00	0.05
492	002941	N新文建	11,800	306,800.00	0.05
493	000761	本钢板材	65,400	281,220.00	0.04
494	603650	彤程新材	12,100	264,264.00	0.04
495	002946	新乳业	15,400	233,156.00	0.04
496	600917	重庆燃气	32,300	224,808.00	0.03
497	603025	大豪科技	19,630	201,011.20	0.03

498	603877	太平鸟	11,000	170,720.00	0.03
499	603569	长久物流	14,460	167,591.40	0.03

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002405	四维图新	4,538,576.00	2.76
2	002157	正邦科技	3,572,745.00	2.17
3	300347	泰格医药	3,399,673.00	2.07
4	002049	紫光国微	3,096,559.00	1.88
5	000656	金科股份	3,050,935.12	1.86
6	000860	顺鑫农业	2,998,173.00	1.82
7	002916	深南电路	2,900,897.60	1.76
8	000596	古井贡酒	2,880,660.00	1.75
9	600739	辽宁成大	2,841,408.00	1.73
10	002410	广联达	2,806,078.00	1.71
11	000723	美锦能源	2,760,622.80	1.68
12	300146	汤臣倍健	2,725,875.00	1.66
13	002195	二三四五	2,696,945.00	1.64
14	600763	通策医疗	2,658,242.00	1.62
15	300253	卫宁健康	2,613,357.56	1.59
16	002384	东山精密	2,604,216.00	1.58
17	002385	大北农	2,598,227.22	1.58
18	002075	沙钢股份	2,548,192.00	1.55
19	002129	中环股份	2,519,056.00	1.53
20	300450	先导智能	2,508,996.00	1.53

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300347	泰格医药	4,327,246.00	2.63
2	002410	广联达	3,903,871.00	2.37

3	000656	金科股份	3,430,980.00	2.09
4	000596	古井贡酒	3,298,628.00	2.01
5	300146	汤臣倍健	3,148,757.15	1.91
6	600600	青岛啤酒	2,978,713.55	1.81
7	603899	晨光文具	2,901,210.56	1.76
8	600256	广汇能源	2,606,992.50	1.59
9	300413	快乐购	2,552,759.00	1.55
10	002013	中航机电	2,076,593.10	1.26
11	000333	美的集团	2,027,862.20	1.23
12	600655	豫园股份	1,725,731.80	1.05
13	603658	安图生物	1,664,447.00	1.01
14	002916	深南电路	1,485,486.00	0.90
15	000667	美好集团	1,393,053.00	0.85
16	601598	中国外运	1,329,988.50	0.81
17	600366	宁波韵升	1,242,289.00	0.76
18	000969	安泰科技	1,193,843.00	0.73
19	000612	焦作万方	1,138,282.00	0.69
20	600503	华丽家族	1,136,642.00	0.69

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	400,468,042.55
卖出股票收入（成交）总额	146,160,105.78

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	114,557.87
2	应收证券清算款	2,025,654.59
3	应收股利	-
4	应收利息	893.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,141,105.54

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
415	1, 504, 382. 38	621, 675, 273. 00	99. 58%	2, 643, 414. 00	0. 42%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额 比例
1	张红艳	243, 300. 00	0. 04%
2	姜晓平	235, 683. 00	0. 04%
3	李敏慧	231, 516. 00	0. 04%
4	中信证券股份有限公司	188, 987. 00	0. 03%
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	包宏伟	72, 607. 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	621, 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。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 5 月 29 日)基金份额总额	665, 869, 631. 00
本报告期期初基金份额总额	184, 318, 687. 00
本报告期期间基金总申购份额	498, 000, 000. 00
减：本报告期期间基金总赎回份额	58, 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	624,318,687.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
申万宏源	2	306,720,003.20	56.73%	224,304.35	56.06%	-
长城证券	2	117,427,922.85	21.72%	85,873.94	21.46%	-
招商证券	2	93,053,664.66	17.21%	68,046.23	17.01%	-
国泰君安	2	23,483,122.28	4.34%	21,869.97	5.47%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

兴业证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	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管理席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

国泰君安	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证 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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20190101~20190630	179,486,286.00	498,000,000.00	56,000,000.00	621,486,286.00	99.55%
产品特有风险							

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。

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。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

## 12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2019 年 8 月 28 日