国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金的基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证养老产业指数分级		
场内简称	国寿养老		
交易代码	168001		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月26日		
报告期末基金份额总额	158,325,690.05份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证养老产业指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。		
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如市场流动性不足、成份股被限制投资等)导致基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。		
业绩比较基准	95%中证养老产业指数收益率+5%银行人民币活期存款利率(税后)。		
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所分离的两类基金份额来看,国寿养老A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;国寿养老B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。		
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司		
基金托管人	招商证券股份有限公司		
下属分级基金简称	国寿安保中证养老产业指数分级A	国寿安保中证养老产业指数分级B	国寿安保中证养老产业指数分级
下属分级场内简称	养老A	养老B	国寿养老
下属分级基金交易代码	150305	150306	168001
下属分级基金报告期末基金份额总额	20,800,994.00份	20,800,994.00份	116,723,702.05份
下属分级基金的风险收益特征	国寿养老A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征。	国寿养老B份额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。	本基金为股票型基金,具有较高预期风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	2,974,881.95
2.本期利润	23,670,275.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.1280
4.期末基金资产净值	151,648,416.50
5.期末基金份额净值	0.958

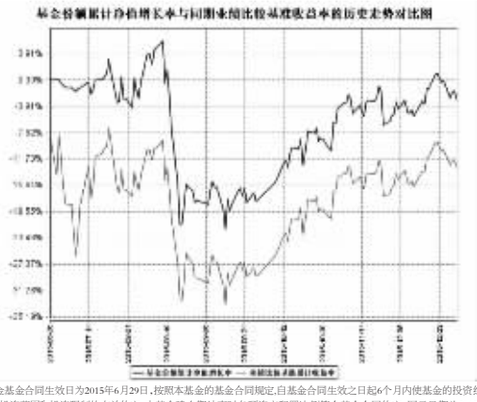
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	18.00%	1.67%	21.06%	1.80%	-3.06%	-0.13%

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



注:本基金基金合同生效日为2015年6月29日,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2015年6月29日至2015年12月31日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴坚	基金经理	2015年6月26日	-	8年	吴坚先生,博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理、中国人寿资产管理有限公司一级研究员,现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金、国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金、国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金基金经理。

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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为;且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 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

2015年4季度,市场在大幅波动之后逐渐恢复常态,本基金本着持有人利益最大化原则,稳健操作,按照基金合同约定顺利完成了建仓工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为0.958元,份额累计净值0.970元。报告期内本基金份额净值增长率为18.00%,同期业绩基准涨幅为21.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年1季度,宏观经济整体仍然处于转型期,经济增速平稳,通胀水平在春节前后季节性上升后总体仍将维持低位。市场可能在各项改革进一步推进、产业转型升级、投资者风险偏好变化等因素共同作用下波动,并孕育投资机会。

本基金将严格遵守基金合同,在建仓期结束后严格跟踪标的指数,力争将跟踪误差降低到最小程度。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	141,642,695.46	92.34
	其中:股票	141,642,695.46	92.34
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	10,163,099.14	6.63
8	其他资产	1,581,438.87	1.03
9	合计	153,387,233.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	64,727,374.37	42.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,400,513.32	9.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,765,254.04	1.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,111,232.30	15.90
J	金融业	7,293,742.00	4.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,577,646.73	2.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,801,360.00	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,729,728.00	1.14
Q	卫生和社会工作	3,305,757.38	2.18
R	文化、体育和娱乐业	18,930,087.32	12.48
S	综合	-	-
	合计	141,642,695.46	93.40

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600085	同仁堂	55,000	2,453,550.00	1.62
2	601601	中国太保	84,600	2,441,556.00	1.61
3	601336	新华保险	46,600	2,432,986.00	1.60
4	601318	中国平安	67,200	2,419,200.00	1.60
5	600135	乐凯胶片	111,300	2,410,758.00	1.59
6	300104	乐视网	37,500	2,205,000.00	1.45
7	002462	嘉事堂	40,900	2,070,358.00	1.37
8	300146	汤臣倍健	52,870	2,035,495.00	1.34
9	601888	中国国旅	33,483	1,985,876.73	1.31
10	002399	海普瑞	55,907	1,977,430.59	1.30

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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合约。

5.10 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合约。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资前十名股票不超出基金合同的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	650,930.19
2	应收证券清算款	920,274.61
3	应收股利	-
4	应收利息	7,137.17
5	应收申购款	3,096.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,581,438.87

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	2,205,000.00	1.45	公告重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国寿安保中证养老产业指数分级A	国寿安保中证养老产业指数分级B	国寿安保中证养老产业指数分级
报告期期初基金份额总额	12,133,395.00	12,133,395.00	110,513,104.88
报告期期间基金总申购份额	-	-	175,934,586.80
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	154,585,688.24
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	8,667,599.00	8,667,599.00	-15,138,301.39
报告期期末基金份额总额	20,800,994.00	20,800,994.00	116,723,702.05

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金拆算变动份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金募集的文件

8.1.2《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》

8.1.3《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.1.5 报告期内国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

8.1.6 中国证监会要求的其他文件

8.2 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。

8.3 查阅方式

8.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

8.3.3 按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
2016年1月20日

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	342,318,687.00份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-20,058,316.66
2.本期利润	102,499,018.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.3037
4.期末基金资产净值	534,464,068.10
5.期末基金份额净值	1.5613

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。

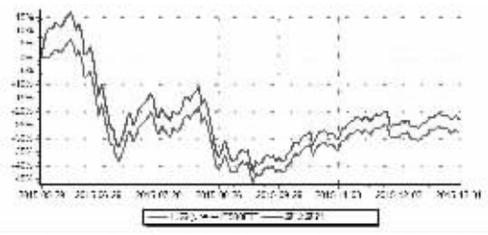
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	24.74%	2.03%	24.40%	2.05%	0.34%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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2015年12月31日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	-	5年	李康先生,博士研究生。2009年10月至2012年12月就职于中国国际金融有限公司,任职量化分析经理;2012年12月至2013年11月就职于长盛基金管理有限公司,任职量化研究员;2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理,现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日,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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为;且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的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成份股调整以及长期停牌股票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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.5613元,累计份额净值为0.7229元。报告期内净值增长率为24.74%,同期业绩基准涨幅为24.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历三季度大幅下跌后,市场在四季度有所反弹。站在当前时点,在基本面探底的局面下,经济转型和改革将是驱动市场的主要因素。流动性宽松有限,且边际效用降低。整体是存量资金博弈的行情,未来市场将以结构性的投资机会为主。同时,外围经济环境和汇率波动等因素影响,有可能加剧股票市场波动。

本基金将严守基金合同及相关法律法规,秉承指数化投资管理策略,以量化分析为基础不断优化改进投资方案,力争将相对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	524,946,562.09	98.10
	其中:股票	524,946,562.09	98.10
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	9,694,764.80	1.81
8	其他资产	492,917.09	0.09
9	合计	535,134,243.98	100.00

注:股票投资包含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	9,775,475.50	1.83
B	采矿业	15,458,223.82	2.89
C	制造业	318,073,029.72	59.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,209,505.90	2.85
E	建筑业	13,944,473.25	2.61
F	批发和零售业	33,706,771.96	6.31
G	交通运输、仓储和邮政业	15,430,683.17	2.89
H	住宿和餐饮业	1,207,713.56	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,563,130.38	5.72
J	金融业	5,605,587.00	1.05
K	房地产业	35,879,052.83	6.71
L	租赁和商务服务业	10,216,635.80	1.91
M	科学研究和技术服务业	2,829,894.50	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	3,994,988.70	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,362,984.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	7,163,607.20	1.34
S	综合	4,525,120.80	0.85
	合计	524,946,878.09	98.22

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600978	宜华木业	149,400	3,336,102.00	0.62
2	002466	天齐锂业	19,000	2,674,250.00	0.50
3	002405	四维图新	68,800	2,669,440.00	0.50
4	000748	长城信息	73,700	2,570,656.00	0.48
5	600160	巨化股份	109,300	2,569,965.00	0.48
6	002018	华信国际	58,200	2,565,456.00	0.48
7	600201	生物股份	69,300	2,562,021.00	0.48
8	600816	安信信托	107,050	2,437,528.50	0.46
9	600079	人福医药	108,920	2,424,559.20	0.45
10	600635	大众公用	238,700	2,353,582.00	0.44

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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合约。

5.10 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合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	483,860.55
2	应收证券清算款	6,592.82
3	应收股利	-
4	应收利息	2,463.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	492,917.09

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	3,336,102.00	0.62	公告重大事项
2	000748	长城信息	2,570,656.00	0.48	公告重大事项
3	002018	华信国际	2,565,456.00	0.48	公告重大事项

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	330,318,687.00
报告期期间基金总申购份额	18,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	6,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	342,318,687.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 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

8.1.2《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》

8.1.3《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》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.1.5 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

8.1.6 中国证监会要求的其他文件

8.2 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

8.3 查阅方式

8.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

8.3.2登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

8.3.3按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
二〇一六年一月二十日

国寿安保场内实时申赎货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015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:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保场内实时申赎货币	
交易代码	519878	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年10月20日	
报告期末基金份额总额	277,192,991,938.00份	
投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。	
业绩比较基准	7天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保场内实时申赎货币A	国寿安保场内实时申赎货币B
下属分级基金的交易代码	519878	519879
报告期末下属分级基金的份额总额	71,633,500,601.00份	205,559,491,337.00份

注:本基金份额净值为0.01元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 — 2015年12月31日)	
	国寿安保场内实时申赎货币A	国寿安保场内实时申赎货币B
1. 本期已实现收益	5,541,690.65	16,707,635.96
2. 本期利润	5,541,690.65	16,707,635.96
3. 期末基金资产净值	716,335,006.01	2,055,594,913.37

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

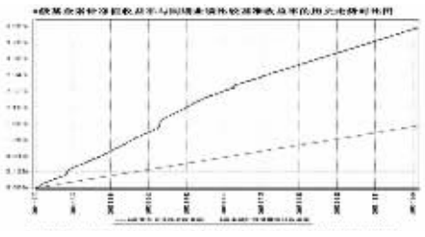
1.国寿安保场内实时申赎货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6323%	0.0010%	0.3403%	0.0000%	0.2920%	0.0010%

2.国寿安保场内实时申赎货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7629%	0.0013%	0.3403%	0.0000%	0.4226%	0.0013%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金基金合同于2014年10月20日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同"第十二部分(三)投资范围、(五)投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桑迎	基金经理	2014年10月20日	-	11年	硕士研究生。2002年7月至2003年8月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年11月至2008年1月,任职于华夏银行总行资金部,担任交易员;2008年2月至2013年12月,任职于嘉实基金,历任交易员、基金经理。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保聚宝盆货币市场基金及国寿安保鑫钱包货币市场基金基金经理。

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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保场内实时申赎货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为;且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度,货币市场受到经济数据不佳、通胀压力降低等多重因素的影响呈现偏宽松的走势。银行间市场隔夜回购利率维持在2%以下,7天回购利率则基本稳定在2.5%以下。本季度需密密切关注汇率因素,随着美国加息落地,人民币汇率不断承压,年底前美岸市场汇率一度突破6.6。外汇占款的下滑直接影响到货币市场的流动性松紧,尽管目前人民币汇率在岸市场仍然稳定可控,但未来仍需要警惕。现券方面,4季度短期债券收益率随着资金面宽松以大幅下行,1年期AAA级别短期融资券收益率季度一度下行至2.80附近。由于近期信用风险事件频繁发生,债券收益率走势出现分化,市场认可的品种收益率追随AAA级别债券收益率快速下行,而市场不认可的产能过剩行