国寿安保增金宝货币市场基金

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:浙商银行股份有限公司
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。

基金托管人浙商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	国寿安保增金宝货币
交易代码	001826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月23日
报告期末基金份额总额	262,011,450.23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	浙商银行股份有限公司

§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	2,069,289.39
2.本期利润	2,069,289.39
3.期末基金资产净值	262,011,450.23

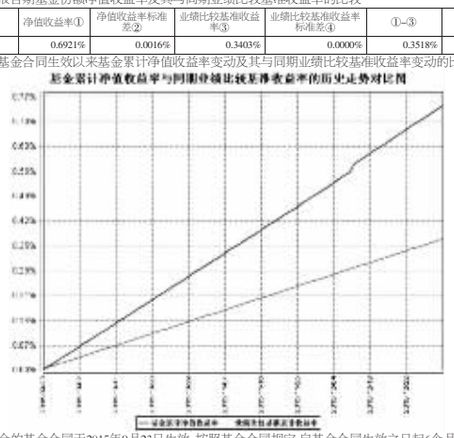
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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

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	0.6921%	0.0016%	0.3403%	0.0000%	0.3518%	0.0016%

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:本基金的基金合同于2015年9月23日生效,按照基金合同规定,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（二）投资范围、（四）投资限制"的有关约定。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。

§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		
黄力	基金经理	2015年9月23日	-	5年	黄力先生,硕士,中国籍,曾任中国人寿资产管理有限公司投资经理助理;现任国寿安保货币市场基金、国寿安保增金宝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》、《国寿安保增金宝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 报告期内基金的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年第四季度,国内经济继续疲弱,通胀增速低位徘徊。股票市场经历了三季度的大幅度调整后,在四季度呈企稳回升的态势。IPO于11月初宣布重启,年前按老办法发行了之前推迟的3批总计28只新股。本基金作为新发基金,四季度期间主要为封闭期。操作上,本基金结合自身规模波动的特性,保持较长的组合久期与较高的融资杠杆,维持较高的静态收益。同时,交易上积极进行价差交易,为组合创造超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值收益率为0.6921%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

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年一季度,宏观经济整体偏弱,通胀水平将会保持低位。货币政策将保持稳中偏松,外汇、权益市场的走势可能会成为影响资金市场收益率的重要因素。新股发行方式的改变,减少了资金波动的幅度,从而可能使得货币基金的规模更加稳定。2月1日货币基金新管理办法开始执行,各基金间收益差异会缩小。投资中,我们将继续以保持账户流动性为第一要务,严格控制投资品到期时点,应对季节性规模波动。同时,我们密切关注债券交易性机会。我们的目标是在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。

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	固定收益投资	99,947,057.75	33.51
	其中:债券	99,947,057.75	33.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	196,352,599.99	65.83
4	其他资产	1,992,444.22	0.67
5	合计	298,292,101.96	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	4.73	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	35,999,746.00	13.74
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	37.53	13.74
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	45.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	15.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	15.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		113.09	13.74

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,982,841.21	7.63
	其中:政策性金融债	19,982,841.21	7.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	79,964,216.54	30.52
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	99,947,057.75	38.15
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	071507008	15中信建投CP008	200,000	19,996,004.41	7.63
2	011599652	15阳泉SCP004	200,000	19,991,784.22	7.63
3	011580006	15宛矿SCP006	200,000	19,989,619.81	7.63
4	041552051	15三环CP002	200,000	19,986,808.10	7.63
5	130215	13国开15	100,000	9,993,509.97	3.81
6	130233	13国开33	100,000	9,989,331.24	3.81

5.5.1 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0856%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0225%

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 投资组合报告附注

5.7.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持1.00元。

5.7.2 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.7.3 报告期内本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。

5.7.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,992,444.22
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,992,444.22

5.7.5 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	310,246,761.98
报告期期间基金总申购份额	2,073,446.87
减:报告期期间基金总赎回份额	50,308,758.62
报告期期末基金份额总额	262,011,450.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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增金宝货币市场基金募集的文件

8.1.2《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》

8.1.3《国寿安保增金宝货币市场基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.1.5 报告期内国寿安保增金宝货币市场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 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
2016年1月20日

国寿安保智慧生活股票型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	国寿安保智慧生活股票
交易代码	001672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月1日
报告期末基金份额总额	841,552,668.33份
投资目标	本基金在深入研究的基础上,自下而上精选开拓和建设智慧生活的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票投资策略外,本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略,进一步为基金组合规避风险、增强收益。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此专理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在债券类资产的投资上,将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率 X 80%+中债综合指数收益率（全价）X 20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中的高风险/高收益品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	85,631,365.06
2.本期利润	156,587,728.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.2286
4.期末基金资产净值	1,039,386,120.73
5.期末基金份额净值	1.235

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。

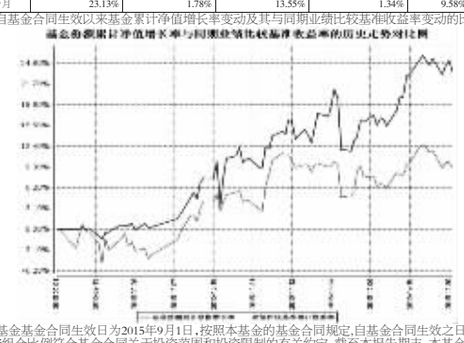
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	23.13%	1.78%	13.55%	1.34%	9.58%	0.44%

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:本基金基金合同生效日为2015年9月1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。截至本报告期末,本基金建仓期尚未结束。图示日期为2015年9月1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9月1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段研究员,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、国寿安保智慧生活股票型证券投资基金及国寿安保成长优选股票型证券投资基金基金经理。
张琦	基金经理	2015年9月23日	-	10年	2005年1月至2015年5月,任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理等职,2015年6月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保智慧生活股票型证券投资基金及国寿安保成长优选股票型证券投资基金基金经理。

注: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》、《国寿安保智慧生活股票型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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,市场出现了一波较大幅度的反弹,尤其是创业板指数成为市场反弹的主引擎,成交异常活跃,部分个股特别是创业板里的次新股甚至创出了股价新高。市场重新进入了相对亢奋的状态,热点主题层出不穷,譬如新能源汽车、娱乐IP、虚拟现实等。

2015年四季度,国寿安保智慧生活基金由于尚处于成立之后的建仓期,采用相对稳妥的建仓策略,随着安全垫的抬升,逐步提高权益仓位的比例。目前,基金组合的配置整体偏向消费,并兼顾了成长和蓝筹风格。在行业配置上,配置比例相对较高的有医药、大众消费、社会服务、TMT、房地产等。截至2015年12月31日,基金组合中持有的股票市值占资产净值比例为79.69%,持有的债券市值比例为0。

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1.235元,本基金的累计单位净值为1.235元。报告期内本基金份额净值增长率为23.13%,同期业绩基准涨幅为13.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期的时间维度来看,我们对权益市场的投资机会持谨慎乐观的看法,看好权益市场的结构性投资机会。从国内宏观的情况来看,传统经济下行的压力仍然较大,深化改革成为传统经济破局和转型的核心要素。与此同时,新兴经济热火朝天,新的技术趋势和商业模式方兴未艾,正在引导着新的产业趋势的形成。此外,由于传统经济对货币的吸纳能力不强,异常充裕的流动性向虚拟经济转移的趋势并未发生变化,权益资产仍然会是具有相对吸引力的大类资产,权益市场中具有真正稀缺性和切实成长性的标的也一定会受到资金的追捧。

从未来一个季度来看,市场不确定性有所增强,投资者分歧有所加剧。我们会审慎构建投资组合,整体上会维持现有的行业配置方向,整体上会偏向泛消费板块。对于成长股而言,我们倾向于寻找新机会或新逻辑来应对可能出现的分化。我们也会根据市场的变化,适时的对组合进行动态的调整和优化。

未来一个阶段,对于市场潜在的风险点,我们主要关注以下几点:美联储是否会持续加息,美元指数是否会持续走强,从而造成人民币进一步贬值的压力;地缘政治的突发事件;国内货币政策可能的变化。

作为基金管理者,我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧,为投资人创造应有的回报。

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	828,309,551.61	72.48
	其中:股票	828,309,551.61	72.48
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	100,000,000.00	8.75
	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	193,599,630.80	16.94
8	其他资产	20,925,974.81	1.83
9	合计	1,142,835,157.22	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	500,362,019.27	48.14
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	40,371,173.03	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	15,288,902.00	1.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	117,384,722.82	11.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	39,777,963.76	3.83
L	租赁和商务服务业	23,542,424.01	2.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	79,634,712.82	7.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,947,633.90	1.15
S	综合	-	-
	合计	828,309,551.61	79.69

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	000888	峨眉山A	1,695,386	25,108,666.66	2.42
2	000860	顺鑫农业	1,169,943	24,919,785.90	2.40
3	600535	天士力	600,000	24,552,000.00	2.36
4	600305	恒顺醋业	940,000	24,129,800.00	2.32
5	600410	华胜天成	910,000	24,124,100.00	2.32
6	600048	保利地产	2,259,959	24,045,963.76	2.31
7	603899	晨光文具	568,950	23,930,037.00	2.30
8	600138	中青旅	1,009,971	23,542,424.01	2.27
9	600536	中国软件	650,000	23,452,000.00	2.26
10	002262	恩华药业	787,779	23,058,291.33	2.22

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。

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。

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未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	366,624.65
2	应收证券清算款	19,184,420.47
3	应收股利	-
4	应收利息	37,938.18
5	应收申购款	1,336,991.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,925,974.81

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

本基金本报告期末未持有流通受限的股票。

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

报告期期初基金份额总额	684,083,729.31
报告期期间基金总申购份额	237,061,571.57
减:报告期期间基金总赎回份额	79,592,632.55
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	841,552,668.33

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	12,500,562.50
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	12,500,562.50
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	1.49%

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期内未投资本基金。

§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智慧生活股票型证券投资基金募集的文件

8.1.2《国寿安保智慧生活股票型证券投资基金基金合同》

8.1.3《国寿安保智慧生活股票型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 报告期内国寿安保智慧生活股票型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 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
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联接基金

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联接
基金主代码	001241
交易代码	001241
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	365,429,862.24份
投资目标	通过主要投资于中证500交易型开放式指数证券投资基金,紧密跟踪标的指数即中证500指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金不参与目标ETF的投资管理。
业绩比较基准	中证500指数收益率x95%+银行活期存款利率（税后）x5%
风险收益特征	本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金联接基金,跟踪中证500指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。 本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高预期风险、高预期收益的开放式基金。
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

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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	本基金属股票型基金,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似的风险收益特征。

§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	-14,717,706.95
2.本期利润	47,510,703.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1279
4.期末基金资产净值	252,618,349.78
5.期末基金份额净值	0.6913

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。

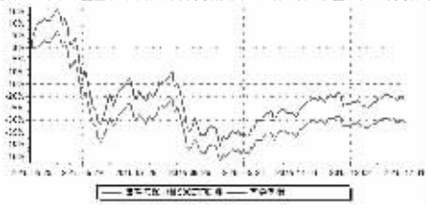
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	22.35%	1.86%	23.13%	1.94%	-0.78%	-0.08%

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:本基金的基金合同生效日为2015年5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联接基金基金合同》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长期停牌股票引起的成份股权重偏离以及持有部分股票逐步换购为目