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4月22日

国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金

2016 第一季度 报告

Disclosure 信息披露

2016年3月31日

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4月21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	客,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、	的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2016年1月1日起至	3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			
交易代码	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	324,318,687.00份			
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求偏离度和误差最小化。			
本基金为完全被动式指数基金、采用完全短制法,即按照成份股在标的指数中的基 推权重米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	本基金分限聚型基金 預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除标指数的表现,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。			

§ 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

3.1 主要财务指标	
1100/19334173	单位:人民币
主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-15,294,784.18
2.本期利润	-102,939,676.40
3.加权平均基金份額本期利润	-0.3033
4.期末基金资产净值	410,977,556.66
5.期末基金份額净值	1.2672
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、非	设验收益、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,计人费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字

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	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	-18.84%	3.18%	-19.19%	3.25%	0.35%	-0.07%
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	
	基金的领域计	经由增长率与国地 域	特比较基在收益	本的从史之势对非	191	
	18385			7 7 7		
	13.22% - 37 4					
	6389					
	(of sky)					
	8 - 8 - A - A - A - A - A - A - A - A -			++		
	12:25					
		N Ch				
	10:00	1971	200	4. 1		
	rese life	MAN TO	- CAMEY	And I		
	W	14 9	The	14		
	1100	W. A. a. C	11-	1		
	18395	VINCO		Wh . 4	- B	
	100000	- W		The state of the	7 - 17 1 1	

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

4.1 基金经理	1(或基金经理/	小组)简介	§ 4 管理人报	告	
姓名	职务	任本基金的基	金经理期限	证券从业年限	
X土石	87.95	任职日期	离任日期	HE 37-3A SE 41-PR	
					李康先生,博 月至2012年1 金融有限公

姓名	职务	任本基金的基	任本基金的基金经理期限		逆明
XI-41	8/1/20	职务 任职日期	ME STAN SET TO MK	120 1973	
李康	基金经理	2015年5月29日	-	6年	李堪先生,博士研究生。2008年10月 自至2012年12月就职于中国是 金融有限公司,任职基化分析经职 是102年21月至2013年11月至2013年11月至2013年11月至2013年11月至2013年11月至 于长盛基金管理有限公司,任职寿经 提出了一个企业,但是102年2013年11月至2013年11月至2013年11月至2013年11月至2013年11月至2013年11月至2013年2013年2013年2013年2013年2013年2013年2013年

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—严格遵守(证券投资基金法)。但寿安保中证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

43.1 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。本报任制,不存在需接收资者利益的不公平交易行为。 43.2 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 开竞价同日页向多级水及工程已经完全人会逐渐,通过风风的分布又到1/31. 开竞价同日页它易成交货外的单边交易是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长期停牌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 野宗庆左。平基金官理人未用軍化分析手段,通过這当的東崎令軍 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2016年3月31日,本基金份额净值为1.2672元,累计份额净值为0.5868元。报告期内净值增长率为-18.84%,同期

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 § 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	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	408,568,672.05	99.28
	其中:股票	408,568,672.05	99.28
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	买人返售金融资产	-	_
	其中:买断式回购的买人返售金融资 产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,824,429.33	0.69
8	其他资产	123,560.03	0.03
9	合计	411,516,661.41	100.00
5.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	<u> </u>	
代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
Α	农、林、牧、渔业	8.179.590.	72 1.99

-	of the H				
В	采矿业			13,910,791.84	3.38%
С	制造业			246,782,730.69	60.05%
D	电力、热力、燃气及水	生产和供应业		11,496,082.20	2.80%
E	建筑业			11,683,689.22	2.84%
F	批发和零售业			26,027,735.46	6.33%
G	交通运输、仓储和邮政	talk.		12,080,718.51	2.94%
Н	住宿和餐饮业			927,726.67	0.23%
I	信息传输、软件和信息	技术服务业		24,018,578.88	5.84%
J	金融业			4,074,390.50	0.99%
K	房地产业			27,081,339.74	6.59%
L	租赁和商务服务业			7,199,349.90	1.75%
M	科学研究和技术服务	4k		1,777,240.00	0.43%
N	水利、环境和公共设施	管理业		3,379,959.50	0.82%
0	居民服务、修理和其他	服务业		-	_
P	教育			-	_
Q	卫生和社会工作			1,192,500.00	0.29%
R	文化、体育和娱乐业	文化,体育和娱乐业		5,518,070.78	1.34%
S	综合	ich care		3,238,177.44	0.79%
	合计			408,568,672.05	99.41%
5.3 ‡	B告期末按公允价值占	基金资产净值比例为	:小排序的前十名股	票投资明细	
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	002466	天齐锂业	18,200	3,053,960.00	0.74
2	002018	华信国际	58,200	2.565,456,00	0.62

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	(%)
1	002466	天齐锂业	18,200	3,053,960.00	0.74
2	002018	华信国际	58,200	2,565,456.00	0.62
3	600654	中安消	75,500	2,177,420.00	0.53
4	600584	长电科技	97,000	2,135,940.00	0.52
5	600201	生物股份	66,400	2,054,416.00	0.50
6	600122	宏图高科	104,600	2,031,332.00	0.49
7	600079	人福医药	104,220	1,938,492.00	0.47
8	002085	万丰奥威	52,800	1,881,792.00	0.46
9	002405	四维图新	69,800	1,849,002.00	0.45
10	000748	长城信息	75,400	1,775,670.00	0.43

10 00748 长城信息 75,400 1,775,670.00
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金末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单值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金末程告期末未持有股票,未持有股票,发持证券。
5.6 报告期末按公允价值占基金资产单值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金非股票期末未持有股票。
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
本基金非股票期末未持有收证。
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
本基金非股票期末未持有权证。
5.9 报告期末未转有股证,
5.9 报告期末本基金投资的股胜期货交易情况说明
本基金非货品期末未持有股值财
在基金本报告期末未持有股值财
5.10 报告期末本基金投资的股值财赁交易情况说明
本基金本报告期末未持有股值财
5.10 报告期末本基金投资的国值财赁交易情况说明

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

序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	122,757.
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	802.3
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	123,560.

	5 报告期末前十名股票				
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	002018	华信国际	2,565,456.00	0.62	公告重大事项
2	600654	中安消	2,177,420.00	0.53	公告重大事项
3	600584	长电科技	2,135,940.00	0.52	公告重大事项
4	600122	宏图高科	2,031,332.00	0.49	公告重大事项
5	002405	四维图新	1,849,002.00	0.45	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 由于四舍五人的原因,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

报告期期初基金份额总额	342,318,687.00
报告期期间基金总申购份额	2,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	20,000,000.00
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	324,318,687.00
《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》

8.1.5 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 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

国寿安保基金管理有限公司 2016年4月22日

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

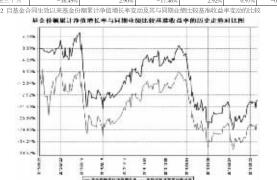
2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金托管人:招商业券股份有报告送出日期:2016年4月22日		提示	
表现和投资组合报告等内容,原 基金管理人承诺以诚实信用	果证本报告所载资料不存在成 责任。 最公司根据本基金的基金合同 证复核内容不存在虚假记载 勤勉尽责的原则管理和运用 未来表现。投资有风险,投资。	總假记载、误导性陈述或重大: 期规定,于2016年4月21日复核 误导性陈述或者重大遗漏。 基金资产,但不保证基金一定 者在作出投资决策前应仔细 品概况	了本报告中的财务指标、净
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	283,157,638.72份		
投资目标	本基金采用指数化投资策略 将基金的净值增长率与业绩 内,年跟踪误差控制在4%以	,紧密跟踪中证养老产业指数 比较基准之间的日均跟踪偏居 内。	。在正常市场情况下,力争 8度绝对值控制在0.35%以
投资策略	资组合,并根据标的指数成份 场流动性不足、成份股被限制	即按照标的指数的成份股构成 分股及其权重的变动进行相应 制投资等)导致基金无法获得以 方法构建本基金的实际投资组	调整。但因特殊情况(如市 足够数量的股票时,基金管
业绩比较基准	95%中证券老产业指数收益:	率+5%银行人民币活期存款利	率(税后)。
风险收益特征	收益高干货币市场基金 债券	交高预期风险、较高预期收益的 条型基金和混合型基金。从本 F低预期风险、预期收益相对稳 目对较高的特征。	基金所分离的两类基金份
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	国寿安保中证券老产业指 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 額总額	82,587,744.00份	82,587,744.00份	117,982,150.72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、较高预期风险、较高预期风险、投资期风险、投资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	D基金净值表现	
3.1 主要财务指标			单位:人民币元

4.期末基金资产净值 226,586,242.0 在那种间之类的线上5日858年7月11-80个 在期种间为全期的企业的设计。 上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的冬项费用,计人费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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 净值增长率标准差 业绩比较基准 收益率③ 阶段 净值增长率① 1)-(3) 2-4



3.3 其他指标

§ 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
	RX 95	任职日期	离任日期	NE 55-50, SE 41-PR	06.93
型吳	基金经理	2015年6月26日	-	8年	與繁先生,博士研究也。曾任中国 建设银行云南介行副整理,中国人 有资产管理有限公司一级研究员, 现任国寿安保沪深30和报数型产产 招数分级证券投资基金。但看寿安保 指数分级证券投资基金,但看寿安保 智慧生活股票型证券投资基金, 是 有寿安保成长选银健康型证券投资基金 发展。 完全是一个企业, 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保中证券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捐宝基金价额持有人利益的行为。

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。

4.22 开吊父系门7的专项规则 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运作分析

本基金建仓期已于2015年4季度结束,建仓期结束后本基金严格遵守基金合同,紧密跟踪标的指数,尽最大努力降低

際误差。 4.5报告期内基金的业绩表现 截至2016年3月31日,本基金份额净值为0.800元,份额累计净值0.810元。报告期内本基金份额净值增长率为-16. %。同期业绩基准涨概为-17.46%。 4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 无。

5.1	设告期末基金资产组合情况		
序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	211,726,012.63	91.72
	其中:股票	211,726,012.63	91.72
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,872,120.13	7.74
8	其他资产	1,245,626.44	0.54
9	合计	230,843,759.20	100.00
5.2	设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		
В	采矿业		

22,503,903.

11,808,305. 5,021,448.9

P	秋 时		2,629,158.00		1.16%
Q	卫生和社会工作		5,787,414.84		2.55%
R	文化、体育和娱乐业			25,737,707.32	11.36%
S	综合				
	合计		2	11,726,012.63	93.44%
5.3 报	告期末按公允价值占基金	它资产净值比例大/	小排序的前十名股票	投资明细	
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	601601	中国太保	157,411	4,128,89	90.53 1.82
2	601318	中国平安	125,100	3,979,43	31.00 1.76
3	601336	新华保险	91,200	3,699,98	84.00 1.63
4	002007	华兰生物	81,599	3,622,17	79.61 1.60
5	000423	东阿阿胶	68,003	3,301,54	45.65 1.46
6	000963	华东医药	46,958	3,284,71	12.10 1.45
7	600535	天士力	84,473	3,280,08	86.59 1.45
8	600135	乐凯胶片	205 500	3 273 61	15.00 1.44

交通运输、仓储和邮品

O 居民服务、修理和其他服务

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。

华盛並平取官時外不付申回芬。 56.报告期末被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 本基金本报告期末来持有资产支持证券。 57.报告期末被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。

不確認之中民日初/小月日 1828-1848 5-8 报告期末被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 本基金本报告期末本持有权证。 5-9 报告期末本集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推削货。

5.10 报告期末本基金投资的

本基金本报告期末未持有国债期货

2.1.1 x RRAETRETRILL 3.11.1 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通 33.

2 应收证券清算影 待摊费用

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的股票。

报告期期间基金总申购份额	-	-	159,755,221.69
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	34,923,273.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	61,786,750.00	61,786,750.00	-123,573,500.00
报告期期末基金份额总额	82,587,744.00	82,587,744.00	117,982,150.72
§ 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	
0 t			

8.1 备查文件目录
8.1.1 中国正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各同)
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 基金管理业业多资格批件 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 中国正监会要求的其他文件
8.2 存放他员。
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号院盈泰商多中心2号楼11层。
8.3 春烟方式

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4月22日

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司 报告送出日期:2016年4月22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走带责任。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4月21日复核了本报告中的财务指标、

帶值表現和投資組合报告等內容。保证資格的客不存在底假记载。提导性除述或者重大遗漏。 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

基金简称	国寿安保中证500ETF联接
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	361,793,072.41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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
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 其风险收益转巨与标的指数所表征的市场组合的风险收益转证相似。 本基金属于股票型基金,其預期收益及預期风险水平离于混合型基金 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 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,預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 数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,818,090.47
2.本期利润	-44,287,104.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1217
4.期末基金资产净值	206,365,792.82
5.期末基金份額净值	0.5704

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

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

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金份额	版计净值增长率与同期业绩比:	校基准校益率的历史走势对比例	序号	项目	金額(元)	占基金总资产的比例(%)
A			1	权益投资	3,938,990.26	1.91
- 1				其中:股票	3,938,990.26	1.91
- WY			2	基金投资	189,429,021.62	91.66
- 4			3	固定收益投资	-	_
. 7				其中:债券	-	-
	1.00	1 1		资产支持证券	-	-
	1/2°2'\	Mary I	4	贵金属投资	-	-
	War War III.	ment	5	金融衍生品投资	-	-
	1 Porton	1000 00	6	买人返售金融资产	-	-
	"Lyn	War June		其中:买断式回购的买人返售金融资 产	-	-
		4 4 2 4	7	银行存款和结算备付金合计	13,270,385.55	6.42
100	NO 188 180 180 180 180 180 180 180 180 180	ALL SECTION OF SECTION	8	其他资产	35,351.09	0.02
	- KARMENDOWKE A	RESERVES.	9	合计	206,673,748.52	100.00
金合同生	效日为2015年5月29日,按照本基金的 同关于投资范围和投资限制的有关约	的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使 1定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合	基金 5.2 指 基金 5.2.1	告期末按行业分类的股票投资组合 报告期末按行业分类的境内股票投资组	合	
			代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

600429

§ 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 说明 自数证券投资基金联接基金表 2.公理

注:任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。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。
42 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》及其他相关注律法规的规定、本替诚实守信。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。

登勘宣言即《及共祀社大任性法规的》是《中国联大》自《为报告》,不存在通互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 公平交易专项说明
4.3 公平交易电阻的执行情况,报告期外,本基金宣传合法合规,不存在通互基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易电阻的执行情况,报告期外,本基金管型从严格执行了《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。本居告期,不存在损害投资者利益的不公平交易行为。
4.3 是有交易行为的专项说明,报告期外,本基金定处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制可以应收多成交效少的收垃交易超过该证券当日成交量的5×的情形。
4.4 报告期内基本投资资路和运作分析
报告期内,本基金是资资路和运作分析
报告期内,本基金是资源自由思票长期停即等因素引起的成份股权重偏离。日常申联和市场成功等因素,也带来一定的跟途成差。本基金管组失用量、使用量化分析手段。通过适当的策略尽量尤取对银票设差不利因素的影响,并且,逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离。定期分析此代跟影偏高度管理方案。
4.5 报告期内基金的遗传表现

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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	买人返售金融资	j ^{obs}		-	=
	其中:买断式回顺 产	均的买人返售金融!	贫	-	-
7	银行存款和结算	备付金合计		13,270,385.55	6.42
8	其他资产			35,351.09	0.02
9	合计			206,673,748.52	100.00
5.2 报	告期末按行业分类 报告期末按行业分	类的股票投资组合 ↑类的境内股票投	资组合		
代码		业类别	公允价	值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业			-	-
В	采矿业			108,933.00	0.05
С	制造业			2,981,522.38	1.44
D	电力、热力、燃气及	及水生产和供应业		36,834.45	0.02
E	建筑业			12,040.88	0.01
F	批发和零售业			241,776.22	0.12
G	交通运输、仓储和	邮政业		43,446.14	0.02
Н	住宿和餐饮业			-	-
I	信息传输、软件和	信息技术服务业		374,454.28	0.18
J	金融业			14,599.00	0.01
K	房地产业			8,938.61	0.00
L	租赁和商务服务业	k		1,399.60	0.00
M	科学研究和技术服	6 务业		504.00	0.00
N	水利、环境和	公共设施管理业		13,336.00	0.01
0	居民服务、修	- 服务、修理和其他服务业		-	-
P	教育			-	-
Q	卫生和社会工作			3,037.50	0.00
R.	文化、体育和娱乐	业		96,361.00	0.05
S	综合			1,807.20	0.00
	合计			3,938,990.26	1.91
5.2.2 本基金 5.3 担	报告期末按行业分 全本报告期末未投 告期末按公允价值) 奕的沪港通投资! 资沪港通股票。 自占基金资产净值	股票投资组合 比例大小排序的前十名	2.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	000748	长城信息	46,200	1,088,010.0	0.53
2	002018	华信国际	35,500	880,400.0	0.43
3	002219	恒康医疗	42,750	636,975.0	0.31
4	002174	游族网络	3,100	363,878.0	0.18
5	600759	洲际油气	17.230	135.255.5	0.07

0.00	3,037.50	
0.05	96,361.00	
0.00	1,807.20	
1.91	3,938,990.26	
	•	合
	股票投资明细	非序的前十名
占基金资产净值比例(%)	公允价值(元)	(股)
0.53	1,088,010.00	46,200
0.43	880,400.00	35,500
0.31	636,975.00	42,750
0.18	363,878.00	3,100
0.07	135,255.50	17,230
0.05	97,336.00	2,300
0.05	93,744.00	8,400
0.03	72,176.00	10,400
0.03	60,900.00	8,400
0.03	56,277.00	3,900

	2.4.1双百别不不1汉(
5.5 报	告期末按公允价值	1占基金资产净(直比例大小排序的	前五名债券投资	明细	
本基金	*本报告期末未投资	5倍券。				
	告期末按公允价值			前十名资产支持	证券投资明细	
	②本报告期末未投资					
5.7 报	告期末按公允价值	〔占基金资产净值	直比例大小排序的	前五名贵金属投	资明细	
	②本报告期末未投》					
	告期末按公允价值		直比例大小排序的	前五名权证投资	明细	
本基金	*本报告期末未投资	資权证。				
5.9 报	告期末按公允价值	1占基金资产净(直比例大小排序的	前十名基金投资	明细	
序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币 元)	占基金资产净值 比例(%)
1	国寿安保中证 500ETF	股票型	交易型开放式	国寿安保基金 管理有限公司	189,429,021.62	91.79
E 10 1	ロケヤナナナナムが	欠 6/5 I/L+比付けるとう。	日本知识			

1.2 投稅组合报告相注 5.12 投稅组合报告相注 5.12 报告期刊金建设的前十名证券的发行主体除恒康医疗外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。 恒康医疗于2016年4月日公告称,2016年2月1日公司及公司控股股东,实际控制人侧文彬先生分别收到中国证券监 督管理委员会(调查通由书)(产证专调查字2016123号,产证专调查字2016124号)。因公司信息披露涉嫌违反证券法律 法规,侧文彬先生涉嫌违反证券法律注规,根据(中华人民共和国证券法)的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对 公司及闽文彬先生进行立案结合。 5.122 基金投资的前十全股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

.12.3]	其他资产构成	
字号	名称	金額(元)
1	存出保证金	25,945.88
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	-
4	应收利息	2,903.95
5	应收申购款	6,501.26
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	35,351.09
12.4 ‡	B告期末持有的外干转股期的可转换(

5.12.4 报告期末特有的处于转股期的可转换债券明细 本基金本报告期末末特有处于转股期的可转换债券。 5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说用							
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	002018	华信国际	880,400.00	0.43	公告重大事项		
2	002219	恒康医疗	636,975.00	0.31	公告重大事项		
3	600759	洲际油气	135,255.50	0.07	公告重大事项		

5.12.6 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。 § 6 开放式基金份额变动				
				单位:
报告期期初基金份额总额				365,429,862.24
报告期期间基金总申购份额				5,487,290.94
减:报告期期间基金总赎回份都	i			9,124,080.77
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列))		-

67 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

8.1.1 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联接基金募集的文件

8.1.2 《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》 8.1.3 《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金行管协议》 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联接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

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