

国寿安保中证养老产业
指数分级证券投资基金
2016 年年度报告

2016 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

送出日期：2017 年 3 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
§7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
8.12 投资组合报告附注	52
§9 基金份额持有人信息	53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
9.2 期末上市基金前十名持有人	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
§10 开放式基金份额变动	55
§11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8 其他重大事件	57
§12 影响投资者决策的其他重要信息	60
§13 备查文件目录	60
13.1 备查文件目录	60
13.2 存放地点	61
13.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金		
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		
基金主代码	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		
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		
报告期末基金份额总额	176,507,923.20 份		
基金合同存续期间	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015 年 7 月 10 日		
下属分级基金的基金简称	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
下属分级基金的场内简称	养老 A	养老 B	国寿养老
下属分级基金的交易代码	150305	150306	168001
报告期末下属分级基金份额总额	34,734,286.00 份	34,734,286.00 份	107,039,351.20 份

2.2 基金产品说明

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。		
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	国寿养老 B 份额具有高预期风险、预期收	本基金为股票型基金，具有较高预期风

	益相对稳定的特征。	益相对较高的特征。	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。
--	-----------	-----------	---

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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬	郭杰
	联系电话	010-50850744	0755-82943666
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95565
传真		010-50850776	0755-82960794
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
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	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
邮政编码		100033	518026
法定代表人		王军辉	宫少林

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、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-12,925,455.24	-6,690,072.67
本期利润	-25,136,203.52	-2,129,229.95
加权平均基金份额本期利润	-0.1355	-0.0108

本期加权平均净值利润率	-17.01%	-1.14%
本期基金份额净值增长率	-17.94%	-3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-34,603,852.33	-6,151,858.55
期末可供分配基金份额利润	-0.1960	-0.0389
期末基金资产净值	134,611,189.30	151,648,416.50
期末基金份额净值	0.763	0.958
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-20.40%	-3.00%

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

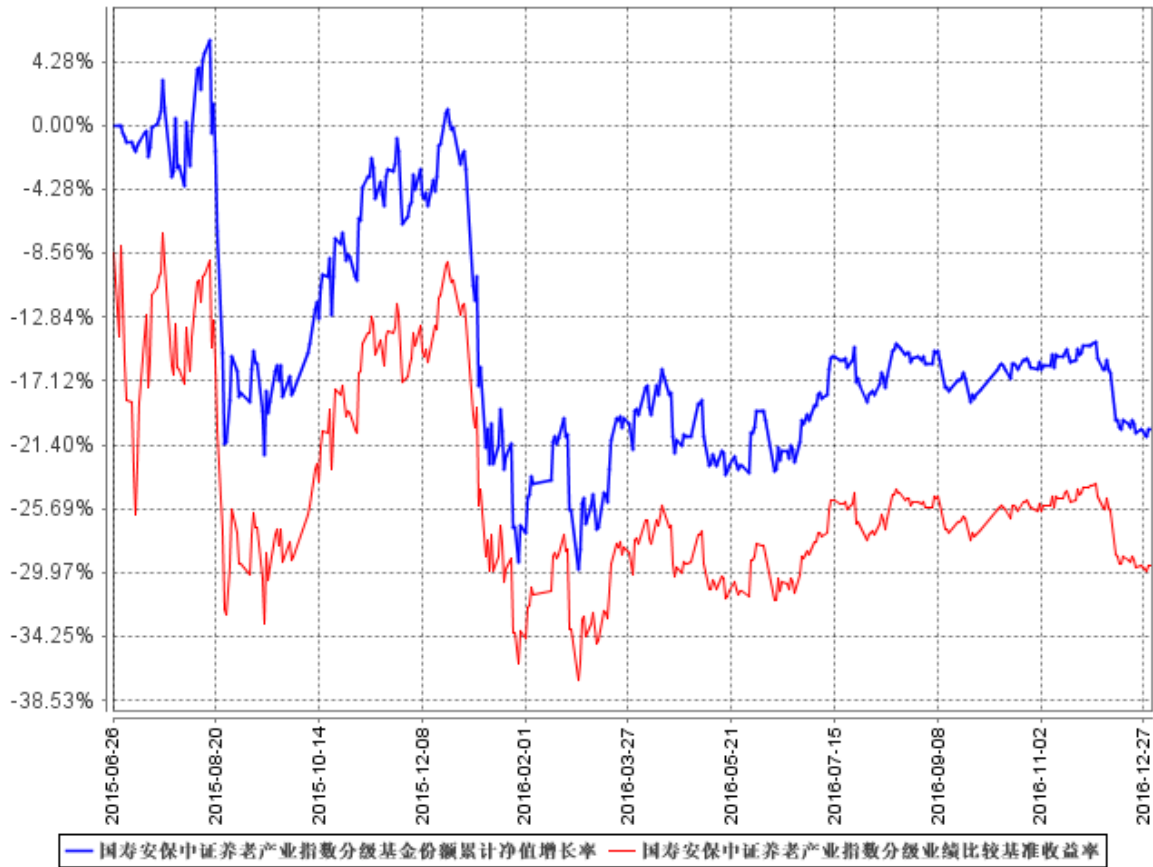
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.16%	0.73%	-3.17%	0.76%	0.01%	-0.03%
过去六个月	-1.24%	0.77%	-1.37%	0.79%	0.13%	-0.02%
过去一年	-17.94%	1.67%	-18.83%	1.66%	0.89%	0.01%
自基金合同生效起至今	-20.40%	1.87%	-29.47%	2.25%	9.07%	-0.38%

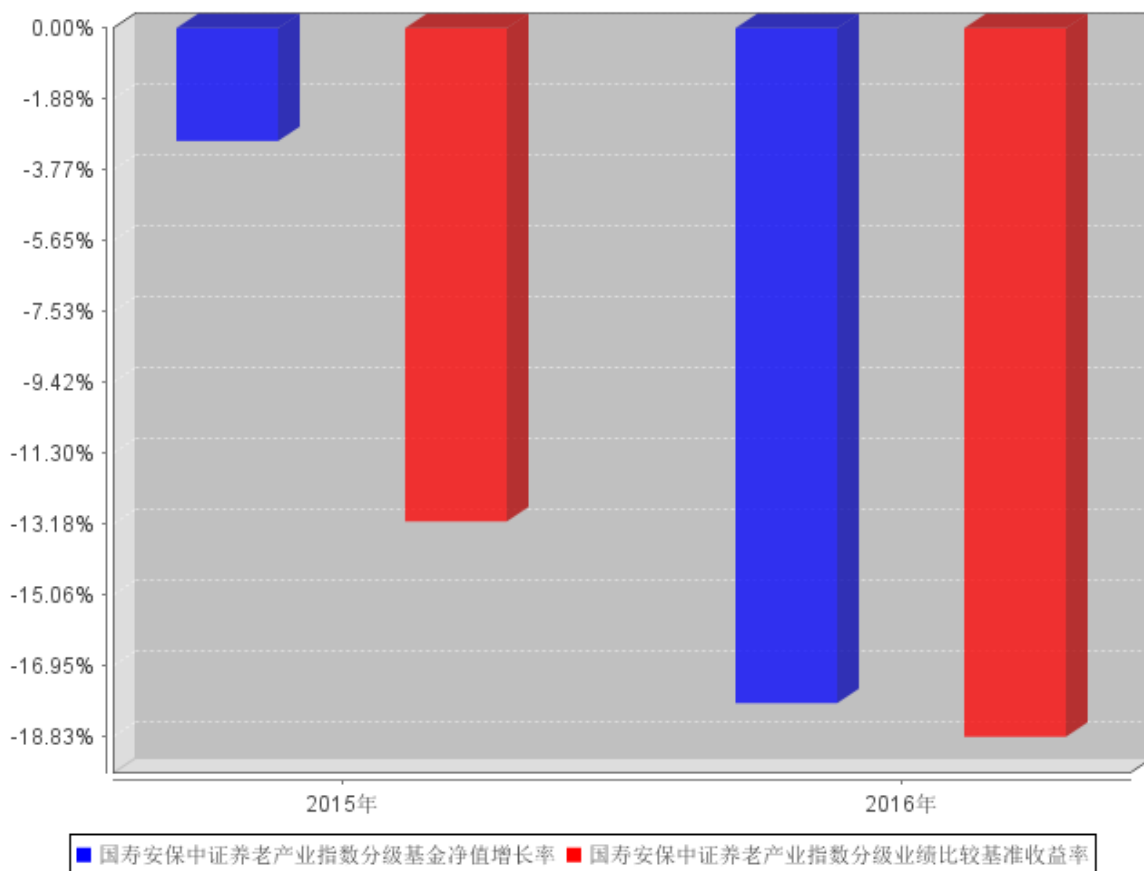
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国寿安保中证养老产业指数分级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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保中证养老产业指数分级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 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 5.88 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 2016 年 12 月 31 日，公司共管理 25 只开放式基金和部分特定资产管理计划，公司管理资产总规模为 1151.37 亿元，其中公募基金管理规模 785.16 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		
吴坚	基金经理	2015 年 6 月 26 日	-	9 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、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及国寿安保稳健增利混合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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科

学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年 A 股市场是逐渐恢复常态的过程。1 季度市场出现了大幅波动，之后，国家采取了一系列救市措施，市场交易逐渐恢复，全年整体表现为震荡行情。受整个市场影响，中证养老产业指数走势同样表现出上述特点。

2016 年本基金严格遵守基金合同，紧密跟踪标的指数，尽最大努力降低跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.763 元，份额累计净值 0.796 元。报告期内本基金份额净值增长率为-17.94%，同期业绩基准涨幅为-18.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年中国经济更可能呈现弱复苏态势。从长周期来看，劳动力、资源等要素成本的逐步抬升使得中国经济潜在增长率逐渐回落，经济增长越来越受到人口老龄化及资源环境的制约。中期而言，中国经济仍然需要消化四万亿刺激政策带来的各类影响，即产能过剩和与之相伴的企业部门的高杠杆问题。短期内虽然中国经济在 16 年下半年受到前期基建地产刺激和出口回暖的支撑，但 17 年中国经济仍然面临房地产市场放缓的拖累，后期工业生产预计会逐渐感受到需求走弱的压力。2017 年通胀风险相对可控，PPI 向 CPI 的传导效率并不高，国内房价涨幅也受到抑制。此外 2017 年油价受

到 OPEC 限产和海外经济回暖的支撑，但考虑到美国页岩油的潜在增产，原油价格上涨空间仍然有限。

从政策面来看，2017 年货币政策基调更加趋于稳健中性，货币政策不具备大幅收紧的基础。财政政策会继续发力，继续推动 PPP 等模式的基建增速。

中国正在快速进入老龄化社会。但与“十三五”规划相比，不管从养老基础设施、养老服务还是相应的金融产品，供给与潜在需求之间还存在巨大差距。2016 年 11 月，国家发改委召开新闻发布会，表示要全面放开市场，让更多的市场主体进入养老服务业，通过公平竞争提升质量，满足人民群众多层次、多样化的需求。中国养老产业正在酝酿巨大的投资机会，投资于中国养老产业将获得长期回报。

作为跟踪中证养老产业指数的产品，本基金将严格遵守基金合同，紧密跟踪中证养老产业指数，力争将跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席

会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任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交易和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
------------	---

审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)审字第 61090605_A11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国寿安保基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	辜 虹	吴 军
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,101,594.08	10,163,099.14
结算备付金		30,149.85	-
存出保证金		55,391.42	650,930.19
交易性金融资产	7.4.7.2	127,328,371.33	141,642,695.46
其中：股票投资		127,328,371.33	141,642,695.46
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	920,274.61
应收利息	7.4.7.5	4,480.21	7,137.17
应收股利		-	-
应收申购款		4,356.19	3,096.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		138,524,343.08	153,387,233.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,448,141.73	712,831.21
应付赎回款		7,244.13	481,513.06
应付管理人报酬		106,352.10	139,063.68
应付托管费		21,270.42	27,812.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	79,118.12	153,781.55
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	251,027.28	223,814.71
负债合计		3,913,153.78	1,738,816.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	169,215,041.63	156,295,948.20
未分配利润	7.4.7.10	-34,603,852.33	-4,647,531.70
所有者权益合计		134,611,189.30	151,648,416.50
负债和所有者权益总计		138,524,343.08	153,387,233.47

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.763 元，基金份额总额 169,215,041.63 份。其中：国寿安保中证养老产业指数分级份额净值 0.763 元，份额总额 107,039,351.20 份；国寿安保中证养老产业指数分级 A 级份额净值 1.002 元，份额总额 34,734,286.00 份；国寿安保中证养老产业指数分级 B 级份额净值 0.524 元，份额总额 34,734,286.00 份；

2、本基金合同于 2015 年 6 月 26 日生效。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金 合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-22,335,005.41	301,525.39
1.利息收入		168,679.40	568,438.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	168,679.40	520,500.14
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		-	47,937.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-10,480,773.24	-5,484,694.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-11,714,072.29	-5,804,877.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,233,299.05	320,183.13
3.公允价值变动收益（损失以	7.4.7.17	-12,210,748.28	4,560,842.72

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	187,836.71	656,939.30
减：二、费用		2,801,198.11	2,430,755.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,473,169.63	937,774.37
2. 托管费	7.4.10.2.2	294,634.04	187,554.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	573,394.44	921,819.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	460,000.00	383,606.12
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-25,136,203.52	-2,129,229.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-25,136,203.52	-2,129,229.95

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	156,295,948.20	-4,647,531.70	151,648,416.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-25,136,203.52	-25,136,203.52
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)	12,919,093.43	-4,820,117.11	8,098,976.32
其中：1. 基金申购款	202,924,874.72	-40,088,492.52	162,836,382.20
2. 基金赎回款	-190,005,781.29	35,268,375.41	-154,737,405.88
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	169,215,041.63	-34,603,852.33	134,611,189.30

项目	上年度可比期间		
	2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	276,524,524.25	-	276,524,524.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,129,229.95	-2,129,229.95
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)	-120,228,576.05	-2,518,301.75	-122,746,877.80
其中：1. 基金申购款	419,456,961.97	-16,784,551.90	402,672,410.07
2. 基金赎回款	-539,685,538.02	14,266,250.15	-525,419,287.87
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)	156,295,948.20	-4,647,531.70	151,648,416.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

基金管理人负责人

左季庆

主管会计工作负责人

韩占锋

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金(简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)证监许可[2015]763号文《关于准予国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金注册的批复》的核准,由国寿安保基金管理有限公司(简称“国寿安保”)于2015年6月8日至2015年6月19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_A05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6月26日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为276,524,524.25份基金份额。根据《基金合同》的约定,基金份额发售结束后,场外认购的全部份额将确认为国寿养老份额;场内认购的份额将按照1:

1 的比例自动分离为国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额。其中场内认购的基金份额(含募集期利息结转的份额)确认为 105,708,524.00 份,场外认购的基金份额(含募集期利息结转的份额)确认为 170,816,000.25 份。本基金的基金管理人为国寿安保,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为招商证券股份有限公司(简称“招商证券”)。

本基金的基金份额包括国寿养老份额、国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额。根据对基金财产及收益分配的不同安排,本基金的基金份额具有不同的风险收益特征。国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额的配比始终保持 1:1 的比率不变。

每年的基金份额定期折算基准日,本基金将按照《基金合同》的规定对国寿养老 A 份额和国寿养老份额进行定期份额折算。基金份额折算基准日为每年 12 月 15 日(若该日为非工作日,则提前至该日之前的最后一个工作日)。定期份额折算后国寿养老 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元,基金份额折算基准日折算前国寿养老 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为国寿养老份额的场内份额分配给 A 份额持有人。国寿养老份额持有人持有的每两份份额将按一份国寿养老 A 份额获得新增份额的分配,经过上述份额折算后,国寿养老份额的基金份额净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后,国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。

除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算,即:当国寿养老份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上;当国寿养老 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下。当国寿养老份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上,本基金将分别对国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额和国寿养老份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的比例为 1:1,份额折算后国寿养老 A 份额的基金份额参考净值、国寿养老 B 份额的基金份额参考净值和国寿养老份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当国寿养老 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下,本基金将分别对国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额和国寿养老份额进行份额折算,份额折算后本基金将确保国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的比例为 1:1,份额折算后国寿养老份额的基金份额净值、国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证养老产业指数的成份股、备选成份股、其他股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、

固定收益资产（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（含超短期融资券）、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（权证等）及法律法规或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）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证养老产业指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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（以下合称“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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金的报告期间为 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要是股票投资等。

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按照估值原则进行估值仍不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实

际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

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

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

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

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

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率计提；

(2) 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提；

(3) 标的指数许可使用费按本基金资产净值的 0.02%的年费率逐日计提。基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起，指数使用许可费的收取下限为每季度 5 万元；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在存续期内，本基金（包括国寿养老份额、国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额）不进行收益分配。

在未来法律法规或监管机构允许的前提下，基金管理人有权根据新的法律法规和政策制定和调整本基金的收益分配方案，并相应修改国寿养老 A 份额、国寿养老 B 份额基金份额参考净值的计算公式，以及决定是否修改基金份额折算等相关内容。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金于本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股

东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	11,101,594.08	10,163,099.14
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	11,101,594.08	10,163,099.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	134,978,276.89	127,328,371.33	-7,649,905.56
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		134,978,276.89	127,328,371.33	-7,649,905.56
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		137,081,852.74	141,642,695.46	4,560,842.72
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		137,081,852.74	141,642,695.46	4,560,842.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,437.75	6,814.87
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	14.96	-
应收债券利息	-	-
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	27.50	322.30

合计	4,480.21	7,137.17
----	----------	----------

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	79,118.12	153,781.55
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	79,118.12	153,781.55

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	27.28	1,814.71
预提费用	201,000.00	172,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	251,027.28	223,814.71

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	158,325,690.05	156,295,948.20
本期申购	187,007,221.04	184,586,179.45
本期赎回(以“-”号填列)	-191,630,247.14	-189,164,380.86
- 基金拆分/份额折算前	153,702,663.95	151,717,746.79
基金拆分/份额折算变动份额	4,563,416.89	-
本期申购	19,119,294.56	18,338,695.27
本期赎回(以“-”号填列)	-877,452.20	-841,400.43
本期末	176,507,923.20	169,215,041.63

注：(1) 根据《基金合同》的约定，基金份额发售结束后，场外认购的全部份额将确认为国寿养老份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比例自动分离为国寿养老 A 份额与国寿养老 B 份额。折算拆分后，于基金合同生效日，本基金份额总额 276,524,524.25 份；

(2) 根据本基金的基金合同、招募说明书及上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的规定，本基金以 2016 年 12 月 15 日为份额折算基准日，对国寿养老份额以及国

寿养老 A 份额实施了定期份额折算；

(3) 根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回国寿养老份额，国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露国寿养老 A 份额和国寿养老 B 份额的情况。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,151,858.55	1,504,326.85	-4,647,531.70
本期利润	-12,925,455.24	-12,210,748.28	-25,136,203.52
本期基金份额交易产生的变动数	1,058,622.30	-5,878,739.41	-4,820,117.11
其中：基金申购款	-13,878,708.40	-26,209,784.12	-40,088,492.52
基金赎回款	14,937,330.70	20,331,044.71	35,268,375.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,018,691.49	-16,585,160.84	-34,603,852.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	162,012.68	507,315.10
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	2,859.02	9,677.97
其他	3,807.70	3,507.07
合计	168,679.40	520,500.14

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	214,228,266.31	304,840,317.80
减：卖出股票成本总额	225,942,338.60	310,645,195.67
买卖股票差价收入	-11,714,072.29	-5,804,877.87

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期间及上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日均无债券投资产生的收益/损失。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日均无资产支持证券投资产生的收益/损失。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期间及上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日均无贵金属投资产生的收益/损失。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期间及上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日均无衍生工具产生的收益/损失。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,233,299.05	320,183.13
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,233,299.05	320,183.13

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-12,210,748.28	4,560,842.72
——股票投资	-12,210,748.28	4,560,842.72
——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	-	-
合计	-12,210,748.28	4,560,842.72

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年6月26日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	187,836.71	656,779.83
其他	-	159.47
合计	187,836.71	656,939.30

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年6月26日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	573,394.44	921,819.96
银行间市场交易费用	-	-
合计	573,394.44	921,819.96

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年6月26日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
审计费用	50,000.00	70,000.00
信息披露费	150,000.00	153,000.00
指数使用费	200,000.00	100,606.12
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	460,000.00	383,606.12

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他

须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
招商证券股份有限公司（简称“招商证券”）	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“人寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	国寿资产的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	国寿资产的母公司
中国人寿财产保险股份有限公司（简称“国寿财险”）	集团公司控制的公司
中国人寿电子商务有限公司	集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年6月26日(基金合同生效日)至 2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	144,741,062.08	33.05%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	105,849.17	33.05%	33,020.60	41.74%
关联方名称	上年度可比期间 2015年6月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	-	-	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,473,169.63	937,774.37
其中：支付销售机构的客户维护费	83,409.34	41,177.66

注：基金管理费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年6月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	294,634.04	187,554.89

注：基金托管费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

7.4.10.4.2 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

国寿安保中证养老产业指数分级				
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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
集团公司	93,885,815.24	87.71%	91,178,727.22	57.59%

7.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券	11,101,594.08	162,012.68	10,163,099.14	507,315.10

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 06 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间为进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末及上年度末均无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002462	嘉事堂	2016年9月28日	公告重大事项	42.53	2017年1月12日	38.98	43,280	1,738,425.27	1,840,698.40	-
300104	乐视网	2016年12月7日	公告重大事项	35.80	2017年1月16日	36.88	26,300	1,270,702.88	941,540.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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（所有者权益）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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	11,101,594.08	-	-	-	11,101,594.08
结算备付金	30,149.85	-	-	-	30,149.85
存出保证金	55,391.42	-	-	-	55,391.42
交易性金融资产	-	-	-	127,328,371.33	127,328,371.33
应收利息	-	-	-	4,480.21	4,480.21
应收申购款	-	-	-	4,356.19	4,356.19
资产总计	11,187,135.35	-	-	127,337,207.73	138,524,343.08
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,448,141.73	3,448,141.73
应付赎回款	-	-	-	7,244.13	7,244.13
应付管理人报酬	-	-	-	106,352.10	106,352.10
应付托管费	-	-	-	21,270.42	21,270.42
应付交易费用	-	-	-	79,118.12	79,118.12
其他负债	-	-	-	251,027.28	251,027.28
负债总计	-	-	-	3,913,153.78	3,913,153.78
利率敏感度缺口	11,187,135.35	-	-	123,424,053.95	134,611,189.30
上年度末 2015 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	10,163,099.14	-	-	-	10,163,099.14
存出保证金	650,930.19	-	-	-	650,930.19
交易性金融资产	-	-	-	141,642,695.46	141,642,695.46
应收证券清算款	-	-	-	920,274.61	920,274.61
应收利息	-	-	-	7,137.17	7,137.17
应收申购款	-	-	-	3,096.90	3,096.90
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,814,029.33	-	-	142,573,204.14	153,387,233.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	712,831.21	712,831.21
应付赎回款	-	-	-	481,513.06	481,513.06
应付管理人报酬	-	-	-	139,063.68	139,063.68
应付托管费	-	-	-	27,812.76	27,812.76
应付交易费用	-	-	-	153,781.55	153,781.55
其他负债	-	-	-	223,814.71	223,814.71
负债总计	-	-	-	1,738,816.97	1,738,816.97
利率敏感度缺口	10,814,029.33	-	-	140,834,387.17	151,648,416.50

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款等，除此之外的金融

资产和金融负债均不计息。因此市场利率的变动对于本资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于中证养老产业指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	127,328,371.33	94.59	141,642,695.46	93.40
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	127,328,371.33	94.59	141,642,695.46	93.40

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据本报告期所有交易日的基金资产净值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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
+5%		6,958,254.62	7,082,124.77
-5%		-6,958,254.62	-7,082,124.77

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

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

(1)各层次金融工具公允价值

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 124,546,132.93 元（上年度末：137,678,867.46 元），属于第二层次的余额为人民币 2,782,238.40 元（上年度末：3,963,828.00 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，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，由第一层次向第二层次的投资的金额为人民币 2,070,358.00 元，无属于由第二层次转入第一层次公允价值的情况。本基金上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 6 月 26 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产均未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	127,328,371.33	91.92
	其中：股票	127,328,371.33	91.92
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,131,743.93	8.04
7	其他各项资产	64,227.82	0.05
8	合计	138,524,343.08	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	51,417,390.53	38.20
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	10,126,999.93	7.52
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,629,049.62	1.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,308,142.11	21.03
J	金融业	7,984,986.71	5.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,632,479.20	3.44

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,563,055.00	1.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,703,614.00	1.27
Q	卫生和社会工作	2,986,117.50	2.22
R	文化、体育和娱乐业	16,976,536.73	12.61
S	综合	-	-
	合计	127,328,371.33	94.59

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	61,168	2,167,182.24	1.61
2	601336	新华保险	49,200	2,153,976.00	1.60
3	601601	中国太保	74,911	2,080,278.47	1.55
4	002252	上海莱士	79,815	1,842,928.35	1.37
5	002462	嘉事堂	43,280	1,840,698.40	1.37
6	600959	江苏有线	157,720	1,782,236.00	1.32
7	601933	永辉超市	353,400	1,735,194.00	1.29
8	600715	文投控股	78,500	1,730,925.00	1.29
9	601801	皖新传媒	97,346	1,710,369.22	1.27
10	600518	康美药业	95,600	1,706,460.00	1.27
11	002094	青岛金王	56,800	1,704,000.00	1.27
12	603377	东方时尚	42,200	1,703,614.00	1.27
13	002007	华兰生物	47,538	1,699,483.50	1.26
14	600998	九州通	81,600	1,692,384.00	1.26
15	600535	天士力	40,673	1,687,522.77	1.25
16	600196	复星医药	72,700	1,682,278.00	1.25
17	000538	云南白药	22,032	1,677,736.80	1.25
18	002399	海普瑞	91,882	1,674,090.04	1.24
19	000963	华东医药	23,115	1,665,898.05	1.24
20	600079	人福医药	83,500	1,665,825.00	1.24
21	601888	中国国旅	37,983	1,648,462.20	1.22
22	600887	伊利股份	92,600	1,629,760.00	1.21
23	600315	上海家化	60,100	1,629,311.00	1.21
24	600754	锦江股份	55,297	1,629,049.62	1.21
25	002294	信立泰	55,648	1,627,147.52	1.21

26	002508	老板电器	44,200	1,626,560.00	1.21
27	000623	吉林敖东	52,400	1,623,876.00	1.21
28	600276	恒瑞医药	35,613	1,620,391.50	1.20
29	601607	上海医药	82,699	1,617,592.44	1.20
30	000100	TCL 集团	490,000	1,617,000.00	1.20
31	000848	承德露露	144,210	1,613,709.90	1.20
32	600436	片仔癀	35,100	1,607,229.00	1.19
33	600637	东方明珠	68,703	1,600,779.90	1.19
34	300003	乐普医疗	89,202	1,599,391.86	1.19
35	000917	电广传媒	111,100	1,598,729.00	1.19
36	600867	通化东宝	72,840	1,597,381.20	1.19
37	000156	华数传媒	88,751	1,589,530.41	1.18
38	002195	二三四五	140,100	1,585,932.00	1.18
39	000627	天茂集团	207,000	1,583,550.00	1.18
40	601928	凤凰传媒	151,200	1,583,064.00	1.18
41	600332	白云山	65,900	1,580,282.00	1.17
42	300413	快乐购	68,548	1,575,233.04	1.17
43	300144	宋城演艺	75,221	1,575,127.74	1.17
44	002174	游族网络	59,500	1,573,775.00	1.17
45	600085	同仁堂	50,100	1,572,138.00	1.17
46	600037	歌华有线	102,606	1,571,923.92	1.17
47	002422	科伦药业	97,045	1,564,365.40	1.16
48	600804	鹏博士	71,300	1,563,609.00	1.16
49	000069	华侨城 A	224,900	1,563,055.00	1.16
50	002517	恺英网络	46,400	1,557,184.00	1.16
51	300017	网宿科技	28,921	1,550,454.81	1.15
52	000999	华润三九	62,596	1,547,999.08	1.15
53	300146	汤臣倍健	129,240	1,543,125.60	1.15
54	000587	金洲慈航	103,700	1,543,056.00	1.15
55	601098	中南传媒	92,300	1,537,718.00	1.14
56	000423	东阿阿胶	28,503	1,535,456.61	1.14
57	300015	爱尔眼科	50,725	1,516,677.50	1.13
58	300267	尔康制药	116,008	1,513,904.40	1.12
59	600373	中文传媒	74,700	1,508,940.00	1.12
60	000839	中信国安	164,350	1,508,733.00	1.12
61	002424	贵州百灵	79,500	1,505,730.00	1.12
62	300023	宝德股份	79,700	1,500,751.00	1.11
63	300122	智飞生物	91,000	1,498,770.00	1.11
64	002354	天神娱乐	21,600	1,493,856.00	1.11

65	002555	三七互娱	90,790	1,488,956.00	1.11
66	300027	华谊兄弟	135,345	1,488,795.00	1.11
67	300178	腾邦国际	91,900	1,483,266.00	1.10
68	300244	迪安诊断	45,920	1,469,440.00	1.09
69	002426	胜利精密	177,300	1,466,271.00	1.09
70	000503	海虹控股	34,400	1,446,520.00	1.07
71	300315	掌趣科技	156,092	1,442,290.08	1.07
72	300133	华策影视	126,608	1,437,000.80	1.07
73	300251	光线传媒	146,606	1,430,874.56	1.06
74	300113	顺网科技	53,000	1,425,170.00	1.06
75	300418	昆仑万维	65,510	1,415,016.00	1.05
76	002292	奥飞娱乐	62,300	1,414,210.00	1.05
77	002739	万达院线	25,600	1,384,192.00	1.03
78	300059	东方财富	81,580	1,381,149.40	1.03
79	300383	光环新网	55,300	1,380,288.00	1.03
80	300104	乐视网	26,300	941,540.00	0.70

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超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	601318	中国平安	3,975,977.54	2.62
2	601601	中国太保	3,936,164.03	2.60
3	601336	新华保险	3,840,618.00	2.53
4	300383	光环新网	3,217,881.00	2.12
5	002007	华兰生物	3,164,436.00	2.09
6	601801	皖新传媒	3,096,930.28	2.04
7	600754	锦江股份	2,951,657.00	1.95
8	600887	伊利股份	2,920,138.00	1.93
9	000423	东阿阿胶	2,844,977.52	1.88
10	600085	同仁堂	2,827,211.50	1.86
11	300244	迪安诊断	2,780,625.84	1.83
12	300144	宋城演艺	2,744,980.46	1.81
13	000963	华东医药	2,733,360.95	1.80
14	300418	昆仑万维	2,725,139.00	1.80
15	002399	海普瑞	2,686,807.00	1.77

16	600998	九州通	2,633,240.00	1.74
17	600535	天士力	2,631,296.00	1.74
18	600135	乐凯胶片	2,600,933.00	1.72
19	002094	青岛金王	2,592,223.62	1.71
20	300017	网宿科技	2,591,241.18	1.71

8.4.2 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	600135	乐凯胶片	4,369,374.82	2.88
2	601601	中国太保	4,341,859.55	2.86
3	601318	中国平安	4,248,614.64	2.80
4	002007	华兰生物	3,972,583.32	2.62
5	600060	海信电器	3,955,296.20	2.61
6	600086	东方金钰	3,855,022.00	2.54
7	601336	新华保险	3,852,537.33	2.54
8	000503	海虹控股	3,846,223.00	2.54
9	002024	苏宁云商	3,676,826.49	2.42
10	603000	人民网	3,660,794.00	2.41
11	600661	新南洋	3,648,147.10	2.41
12	600887	伊利股份	3,489,824.66	2.30
13	600633	浙报传媒	3,431,455.96	2.26
14	600827	百联股份	3,405,754.00	2.25
15	000423	东阿阿胶	3,391,920.48	2.24
16	002773	康弘药业	3,247,102.50	2.14
17	000839	中信国安	3,207,335.17	2.11
18	002568	百润股份	3,038,481.09	2.00
19	600085	同仁堂	2,997,572.29	1.98
20	600998	九州通	2,962,099.64	1.95

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	223,838,762.75
卖出股票收入（成交）总额	214,228,266.31

8.5 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投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.7 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投资。

8.8 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投资。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的股票库。

8.11.3 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	55,391.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,480.21
5	应收申购款	4,356.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,227.82

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 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	002462	嘉事堂	1,840,698.40	1.37	公告重大事项

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	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
国寿安保中证养老产业指数分级 A	295	117,743.34	9,539,932.00	27.47%	25,194,354.00	72.53%
国寿安保中证养老产业指数分级 B	1,790	19,404.63	2,441,937.00	7.03%	32,292,349.00	92.97%
国寿安保中证养老产业指数分级	1,496	71,550.37	94,067,441.24	87.88%	12,971,909.96	12.12%
合计	3,581	49,290.12	106,049,310.24	60.08%	70,458,612.96	39.92%

9.2 期末上市基金前十名持有人

国寿安保中证养老产业指数分级 A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	李怡名	19,412,387.00	55.89%
2	中融国际信托有限公司—中融—融晨 3 号证券投资集合资金信托	2,929,925.00	8.44%
3	郑志坤	2,260,114.00	6.51%

4	中融国际信托有限公司-中融-融金添利单一资金信托	1,969,000.00	5.67%
5	上海明沅投资管理有限公司-明沅稳健增长 1 期私募证券投资基金	1,553,242.00	4.47%
6	上海明沅投资管理有限公司-明沅稳健增长 2 期私募投资基金	1,315,556.00	3.79%
7	黄松友	980,100.00	2.82%
8	建信基金-光大银行-中融国际信托-中融-绝对收益策略 2 号	588,400.00	1.69%
9	华富基金-光大银行-中融国际信托-中融-绝对收益策略 1 号	505,509.00	1.46%
10	万家基金-浙商银行-中融国际信托有限公司	500,000.00	1.44%

国寿安保中证养老产业指数分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	付晓萍	4,421,982.00	12.73%
2	李怡名	1,525,165.00	4.39%
3	上海明沅投资管理有限公司-明沅稳健增长 2 期私募投资基金	1,315,556.00	3.79%
4	上海明沅投资管理有限公司-明沅稳健增长 1 期私募证券投资基金	861,786.00	2.48%
5	倪妮	451,852.00	1.30%
6	包蓉蓉	358,300.00	1.03%
7	董昭岐	356,600.00	1.03%
8	辛文忠	354,143.00	1.02%
9	冷才华	303,100.00	0.87%
10	王正明	300,000.00	0.86%
11	黄骏	300,000.00	0.86%
12	李铁柱	300,000.00	0.86%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及基金经理均未持有本基金。

§ 10 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
基金合同生效日（2015 年 6 月 26 日）基金份额总额	52,854,262.00	52,854,262.00	170,816,000.25
本报告期期初基金份额总额	20,800,994.00	20,800,994.00	116,723,702.05
本报告期基金总申购份额	-	-	206,126,515.60
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	192,507,699.34
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	13,933,292.00	13,933,292.00	-23,303,167.11
本报告期期末基金份额总额	34,734,286.00	34,734,286.00	107,039,351.20

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折算变动份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人于 2016 年 12 月 30 日发布公告，王军辉先生自 2016 年 12 月 28 日起任国寿安保基金管理有限公司董事长，相关任职资格已经中国证监会核准，刘慧敏先生因工作调动不再担任。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券		2293,261,298.16	66.95%	214,461.42	66.95%	-
招商证券		2144,741,062.08	33.05%	105,849.17	33.05%	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金临时调整交易时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月4日
2	国寿安保基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月6日
3	国寿安保基金管理有限公司关于指数熔断后旗下部分基金临时调整交易时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月7日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金新增北京乐融多源投资咨询有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月8日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月12日
6	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年1月20日
7	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年2月5日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司、恒天明泽基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年3月1日
9	关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年3月1日
10	国寿安保基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年3月12日
11	国寿安保基金管理有限公司新增珠海盈米财富管理有限	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年3月22日

	公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	报》及公司网站	
12	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 25 日
13	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2015 年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 3 月 28 日
14	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2016 年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 4 月 22 日
15	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加好买基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 5 月 10 日
16	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 6 月 30 日
17	国寿安保基金管理有限公司系统升级公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 8 日
18	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2016 年第二季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 20 日
19	国寿安保基金关于参加诺亚正行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 21 日
20	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金更新招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 8 月 8 日
21	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 8 月 22 日
22	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金 2016 年半年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 8 月 26 日
23	国寿安保基金管理有限公司新增北京汇成基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 26 日
24	国寿安保基金管理有限公司 2016 年第三季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 10 月 24 日

		报》及公司网站	
25	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 11 月 16 日
26	国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 12 日
27	关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 12 日
28	关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间国寿养老 A 份额停复牌的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 16 日
29	关于国寿养老 A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 19 日
30	关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金定期份额折算结果及恢复交易的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 19 日
31	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 22 日
32	国寿安保基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 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养老产业指数分级证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金托管协议》

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

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

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

2017 年 3 月 28 日