国寿安保沪深300指数型证券投资基金

2014 年度报告摘要

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2015年3月30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。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2015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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年6月5日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国寿安保沪深300指数
基金主代码	000613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月5日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,237,491,250.57份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差,实现对标的指数的有效跟踪,以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
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	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其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。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪标的指数市场表现,是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬	林葛
	联系电话	010-66221308	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-66222870	010-63201816

2.4 信息披露方式

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

§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	2014年6月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日
本期已实现收益	109,687,921.90
本期利润	558,216,345.27
加权平均基金份额本期利润	0.3063
本期基金份额净值增长率	52.06%
3.1.2 期末数据和指标	2014年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0887
期末基金资产净值	1,881,917,421.86
期末基金份额净值	1.5208

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。

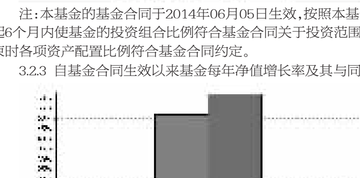
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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

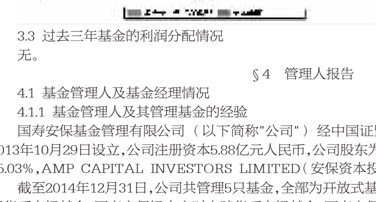
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	41.27%	1.55%	41.63%	1.56%	-0.36%	-0.01%
过去六个月	51.66%	1.20%	59.36%	1.26%	-7.70%	-0.06%
自基金合同生效日起至今(2014年06月05日-2014年12月31日)	52.08%	1.13%	61.99%	1.21%	-9.91%	-0.08%

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:本基金的基金合同于2014年06月05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。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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(以下简称"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,持有股份85.03%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(安保资本投资有限公司),持有股份14.97%。

截至2014年12月31日,公司共管理5只基金,全部为开放式基金,包括3只货币型基金,分别为国寿安保货币市场基金、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;1只指数型基金,国寿安保沪深300指数型证券投资基金;1只债券型基金,国寿安保尊享债券型证券投资基金。公司管理的基金总规模为187.62亿元。

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	2014年6月5日	-	7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》、《国寿安保沪深300指数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 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。

4.3.3 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

本基金于2014年6月成立,报告期内主要处于建仓期。建仓期内本基金牢牢抓住市场机会,加快了建仓节奏,三季度已基本完成建仓工作。随后,本基金严格遵守基金合同规定,采取被动复制指数策略。

报告期内,本基金跟踪误差主要由于建仓初期股票仓位不足引致。标的指数成分股中国人寿和农业银行无法投资,必须寻找其他股票替代,以及申购赎回、成分股停牌和调整等因素,也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段,通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且,逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离,定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.5208元,累计份额净值为1.5208元。报告期内净值增长率为52.08%,同期业绩基准涨幅为61.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年是中国经济转型关键一年,全年GDP增长目标已经下调为7.0%,经济转型升级被放在更加重要位置,将实施积极财政政策和稳健的货币政策。国有企业改革、投融资体制改革、财税体制改革等向纵深推进将成为经济增长和结构优化的重要动力,也将成为影响资本市场的重要因素。在"一带一路"、区域经济一体化、基础设施建设等推动下,传统行业将迎来新的发展机遇;同时,环保、新能源、互联网等新兴行业仍然将面临广阔的发展空间。世界范围内看,2015年美联储加息将是大概率事件,同时欧元区和日本经济也正在走出低谷,国际资本流动将可能对包括中国在内的金融市场造成短暂冲击。在经历2014年快速上涨之后,预计市场波动将进一步加大。本基金将严格遵守基金合同,力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。本基金管理人设有基金估值委员会,估值委员会负责人由公司领导担任,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历。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时,运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务,以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议,向估值委员会提出估值意见或建议,但不参与具体的估值流程。上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人-国寿安保基金管理有限公司2014年6月5日至2014年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本报告已经安永华明会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容,可通过登载于国寿安保基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国寿安保沪深300指数型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日
资 产:	
银行存款	52,211,899.01
结算备付金	46,866.69
存出保证金	710,644.92
交易性金融资产	1,831,226,662.00
其中:股票投资	1,781,156,662.00
基金投资	-
债券投资	50,070,000.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	812,339.97
应收股利	-
应收申购款	1,143,804.10
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,886,152,216.69
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	2,424,448.94
应付管理人报酬	614,878.83
应付托管费	122,975.78
应付销售服务费	-
应付交易费用	859,510.99
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	212,980.29
负债合计	4,234,794.83
所有者权益:	
实收基金	1,237,491,250.57
未分配利润	644,426,171.29
所有者权益合计	1,881,917,421.86
负债和所有者权益总计	1,886,152,216.69

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币1.5208元,基金份额总额1,237,491,250.57份。

7.2 利润表

会计主体:国寿安保沪深300指数型证券投资基金

本报告期:2014年6月5日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年6月5日至2014年12月31日
一、收入	569,978,184.00
1.利息收入	22,809,106.06
其中:存款利息收入	12,583,735.98
债券利息收入	40,940.34
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	10,184,429.74
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	92,775,750.90
其中:股票投资收益	87,521,580.23
基金投资收益	
债券投资收益	1,877,688.13
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	3,376,482.54
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	448,528,423.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,864,903.67
减:二、费用	11,761,838.73
1.管理人报酬	6,161,770.12
2.托管费	1,208,442.99
3.销售服务费	-
4.交易费用	3,897,620.47
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	494,005.15
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	558,216,345.27
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	558,216,345.27

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国寿安保沪深300指数型证券投资基金

本报告期:2014年6月5日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年6月5日至2014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)	5,130,087,968.40	-	5,130,087,968.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	558,216,345.27	558,216,345.27
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)	-3,892,596,717.83	86,209,826.02	-3,806,386,891.81
其中:1.基金申购款	693,238,568.94	192,293,876.65	885,532,445.59
2.基金赎回款	-4,585,835,286.77	-106,084,050.63	-4,691,919,337.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,237,491,250.57	644,426,171.29	1,881,917,421.86

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	左季庆	韩占锋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保沪深300指数型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]376号文《关于核准国寿安保沪深300指数型证券投资基金募集的批复》的核准,由国寿安保基金管理有限公司于2014年5月8日至2014年5月30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(2014)验字第61090605_02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2014年6月5日正式生效,首次设立募集规模为5,130,087,968.40份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为指数型证券投资基金,这也是业内今年首只以沪深300指数为投资标的的指数基金。国寿安保沪深300指数基金采用被动式指数化投资策略,通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差,实现对标的指数的有效跟踪,以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。本基金投资范围主要为标的指数成份股(蓝筹股)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%,投资于标的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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号--公允价值计量》、《企业会计准则第40号--合营安排》和《企业会计准则第41号--在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号--长期股权投资》、《企业会计准则第9号--职工薪酬》、《企业会计准则第30号--财务报表列报》和《企业会计准则第33号--合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号--金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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2014年12月31日的财务状况以及2014年度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2014年6月5日(基金合同生效日)至2014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包括股票投资、债券投资。

(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

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

卖出股票于成交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成交日结转;

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交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;

卖出债券于成交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

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

卖出权证于成交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成交日结转;

(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上述方法进行估值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红利再投资、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) 本基金合同生效日管理费按前一日基金资产净值的0.80%的年费率逐日计提;自2014年6月23日起,年费率变更为0.50%;

(2) 本基金合同生效日托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提;自2014年6月23日起,年费率变更为0.10%;

(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。标的指数许可使用费的收取下限为每季人民币5万元(即不足5万元按照5万元收取);

(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

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 本基金每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金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

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

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、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,继续免征营业税和企业所得税;

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。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

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《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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司(简称"国寿安保")	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司(简称"农业银行")	基金托管人、代销机构
中国人寿资产管理有限公司(简称"人寿资产")	基金管理人的母公司
安保资本投资有限公司(澳大利亚)	基金管理人的股东
中国人寿保险(集团)公司(简称"集团公司")	人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")	人寿资产的母公司
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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月5日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,161,770.12
其中:支付销售机构的客户维护费	95,746.24

注:基金管理费每日计提,按月支付。本基金合同生效日管理费按前一日基金资产净值的0.80%的年费率计提;自2014年6月23日起,年费率变更为0.50%;计算方法如下:

H=E×R/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

R为基金管理费年费率

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年6月5日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,208,442.99

注:基金托管费每日计提,按月支付。本基金合同生效日托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提;自2014年6月202014年6月23日起,年费率变更为0.10%;计算方法如下:

H=E×R/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014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
集团公司	400,000,000.00	32.32%
中国人寿	644,761,950.70	52.10%

7.4.8.5 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 2014年6月5日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	52,211,899.01	426,855.36

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600332	白云山	2014-12-04	重要事项	27.11	2015-01-13	29.82	90,900	2,304,286.22	2,464,299.00
600649	城投控股	2014-11-03	重要事项	7.23		-	270,600	1,854,184.45	1,956,438.00
600664	哈药股份	2014-12-31	重要事项	8.68	2015-02-17	9.45	203,800	1,500,708.73	1,768,984.00
601216	内蒙君正	2014-12-01	拟筹划重大资产重组	10.44	2015-01-07	11.10	104,300	780,495.89	1,088,892.00
000009	中国宝安	2014-12-29	重大事项	12.95	2015-01-07	13.33	320,100	4,373,913.72	4,145,295.00
000413	东旭光电	2014-11-25	重大事项	7.67	2015-01-28	8.44	130,100	976,700.20	997,867.00
000562	宏源证券	2014-12-10	重大事项	30.50		-	269,700	3,193,026.69	8,225,850.00
000883	湖北能源	2014-11-17	重大事项	6.43	2015-03-02	6.43	385,300	1,278,560.36	2,477,479.00

注:申万宏源集团股份有限公司(原名为申银万国证券股份有限公司,以下简称"申万宏源")发行A股股份吸收合并宏源证券的申请已获得中国证券监督管理委员会证监许可[2014]1279号批复的核准;申万宏源换股吸收合并宏源证券的换股股权登记日为2015年1月23日,换股股权登记日收市后宏源证券股东持有的宏源证券股票将按照2.049382716:1的比例转换为申万宏源A股股票,即每1股宏源证券股票换2.049382716股申万宏源A股股票,公司股东换得的申万宏源A股股票将于中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理初始登记后在深圳证券交易所上市交易。申万宏源将于2015年1月26日在深圳证券交易所上市,申万宏源的股票简称为:"申万宏源",股票代码为:"000166"。于2014年12月31日本基金持有宏源证券269,700股,转换成申万宏源552,718.00股;申万宏源于2015年1月26日开盘价格为17.77元。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

§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	1,781,156,662.00	94.43
	其中:股票	1,781,156,662.00	94.43
2	固定收益投资	50,070,000.00	2.65
	其中:债券	50,070,000.00	2.65
	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	52,258,765.70	2.77
7	其他各项资产	2,666,788.99	0.14
8	合计	1,886,152,216.69	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,280,384.00	0.28
B	采矿业	83,843,368.00	4.46
C	制造业	539,281,276.00	28.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	63,942,730.00	3.40
E	建筑业	83,018,210.00	4.41
F	批发和零售业	40,451,065.00	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	47,855,340.00	2.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,613,267.00	3.22
J	金融业	711,010,660.00	37.78
K	房地产业	82,230,350.00	4.37
L	租赁和商务服务业	17,761,710.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	17,970,167.00	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,526,270.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	20,899,844.00	1.11
S	综合	5,472,021.00	0.29
	合计	1,781,156,662.00	94.65

8.3 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

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	1,064,500	79,528,795.00	4.23
2	600016	民生银行	5,764,500	62,717,760.00	3.33
3	600036	招商银行	3,509,600	58,224,264.00	3.09
4	600030	中信证券	1,673,800	56,741,820.00	3.02
5	600837	海通证券	1,720,900	41,404,854.00	2.20
6	601166	兴业银行	2,431,000	40,111,500.00	2.13
7	600000	浦发银行	2,380,100	37,343,769.00	1.98
8	000002	万 科A	2,062,800	28,672,920.00	1.52
9	601398	工商银行	5,721,700	27,864,679.00	1.48
10	601601	中国太保	776,700	25,087,410.00	1.33

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票投资明细,应阅读登载于国寿安保基金管理有限公司网站的年度报告正文。

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	87,427,886.60	4.65
2	600016	民生银行	71,395,974.45	3.79
3	600036	招商银行	70,458,310.05	3.74
4	600030	中信证券	47,617,908.75	2.53
5	601166	兴业银行	47,589,387.62	2.53
6	600000	浦发银行	43,665,027.30	2.32
7	601398	工商银行	37,332,304.00	1.98
8	600837	海通证券	36,845,794.72	1.96
9	000002	万 科A	36,738,064.20	1.95
10	600519	贵州茅台	29,005,835.15	1.54
11	601939	建设银行	29,004,302.89	1.54
12	000651	格力电器	28,422,461.68	1.51
13	601601	中国太保	27,996,616.68	1.49
14	600887	伊利股份	26,646,533.02	1.42
15	601328	交通银行	26,136,558.00	1.39
16	000001	平安银行	23,824,077.13	1.27
17	600104	上汽集团	22,978,794.22	1.22
18	601818	光大银行	21,623,435.92	1.15
19	601668	中国建筑	21,290,601.56	1.13
20	601088	中国神华	19,926,724.15	1.06

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	37,824,017.72	2.01
2	600016	民生银行	31,286,401.65	1.66
3	600036	招商银行	31,260,912.83	1.66
4	601166	兴业银行	21,035,978.95	1.12
5	600030	中信证券	20,553,703.62	1.09
6	600000	浦发银行	19,562,157.49	1.04
7	600837	海通证券	16,217,789.90	0.86
8	601398	工商银行	16,066,149.60	0.85
9	000002	万 科A	15,844,856.43	0.84
10	601939	建设银行	13,752,588.36	0.73
11	600519	贵州茅台	12,522,461.12	0.67
12	000651	格力电器	12,128,227.17	0.64
13	601601	中国太保	12,045,203.98	0.64
14	601328	交通银行	12,013,351.50	0.64
15	000001	平安银行	10,609,840.89	0.56
16	600887	伊利股份	10,224,226.78	0.54
17	600104	上汽集团	10,056,863.98	0.53
18	601818	光大银行	9,860,908.60	0.52
19	601668	中国建筑	9,417,445.00	0.50
20	601088	中国神华	8,746,452.50	0.46

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,234,675,090.05
卖出股票的收入(成交)总额	989,561,831.65

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,070,000.00	2.66
	其中:政策性金融债	50,070,000.00	2.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	50,070,000.00	2.66

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140443	14农发43	500,000	50,070,000.00	2.66

8.7 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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内收到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	710,644.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	812,339.97
5	应收申购款	1,143,804.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,666,788.99

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§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

序号	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
888	1,393,571.23	1,198,128,457.65	96.82%	39,362,792.92	3.18%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	122,875.39	0.01%

9.3 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情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年6月5日)基金份额总额	5,130,087,968.40
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	693,238,568.94
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,585,835,286.77
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,237,491,250.57

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

(1)本报告期内,基金管理人未发生重大人事变动。

(2)因中国农业银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	2	938,524,890.58	29.11%	666,727.59	26.54%	
海通证券	2	845,757,621.47	26.23%	769,976.97	30.65%	
招商证券	2	446,476,847.25	13.85%	317,176.30	12.62%	
银河证券	2	362,200,076.78	11.23%	257,307.27	10.24%	
中信证券	2	232,713,585.32	7.22%	211,861.90	8.43%	
国泰君安	2	158,779,336.89	4.92%	144,552.86	5.75%	
长城证券	2	154,816,242.61	4.80%	109,981.91	4.38%	
中金公司	2	84,968,320.80	2.64%	34,871.04	1.39%	
中银国际	2	-	-	-	-	
中投证券	2	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	

注:根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金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,我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后,向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下:

(1)综合实力较强、市场信誉良好;

(2)财务状况良好,经营状况稳健;

(3)经营行为规范,具备健全的内部控制制度;

(4)研究实力较强,并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告,并能根据特定要求提供定制研究报告;能够积极同我公司进行业务交流,定期来我公司进行观点交流和路演;

(5)具有丰富的投行资源和大宗交易信息,愿意积极为我公司提供相关投资机会,能够对公司业务发展形成支持;

(6)具有费率优势,具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境,能提供全面的交易信息服务;

(7)从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下:

(1)公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构;

(2)公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
申银万国	25,409,396.30	78.05%	1,948,200,000.00	4.32%	-	-
海通证券	-	-	5,965,400,000.00	13.22%	-	-
招商证券	7,147,889.70	21.95%	-	-	-	-
银河证券	-	-	36,813,600,000.00	81.57%	-	-
中信证券	-	-	219,000,000.00	0.49%	-	-
国泰君安	-	-	183,000,000.00	0.41%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

国寿安保基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日