

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8月28日

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8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基金的资产,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摘要、基金合同。

本半年度报告摘要源自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30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 约定开放式

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

报告期基金总份额 407,430,138.87份

2.2 基金产品说明

本基金被动地进行指数化投资策略,通过复制基金组合相对于标的指数的偏度和跟踪误差,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,本基金力求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0.3%,年跟踪误差不超过4%。

本基金采取完全复制策略,即按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。但因特殊情况下(如市场流动性不足、成份股被暂停交易)导致基金无法获得足量的股票时,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,追求尽可能贴近标的指数的表现。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×95%+银行同期存款利率(税后)×5%

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

基金管理人 国寿安保基金管理有限公司

名称 张彤

信息披露义务人

姓名 张彤

联系人 010-508050744

电子邮箱 public@gsfunds.com.cn

客户服务电话 4009-258-268

传真 010-508050776

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 http://www.gsfunds.com.cn

基金半年度报告备置地点 基金管理人、基金托管人处

5.3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

报告期(2015年01月01日-2015年06月30日)

本期已实现收益 709,841,737.47

本期利润 522,417,093.94

加权平均基金份额本期利润 0.5334

本期基金份额净值增长率 26.30%

3.1.2 期间数据和指标 报告期末(2015年06月30日)

本期可供分配基金份额利润 0.9208

期末基金资产净值 782,578,047.69

期末基金份额净值 1.9208

注:本报告期内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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其同行业业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值 增长率(%) 基础收益率 增长率(%) 基础收益率 增长率(%)

过去一个月 -8.33% 3.31% -7.32% -1.15% -0.01%

过去三个月 11.16% 25.26% 2.48% 1.18% 0.04%

过去六个月 26.30% 2.17% 25.29% 2.15% 1.01% 0.02%

过去一年 91.54% 1.74% 99.67% 1.75% -8.13% -0.01%

自基金合同生效以来至 92.08% 1.68% 102.96% 1.70% -10.88% -0.02%

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6月5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资产配置和投资限制的有关规定。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。报告日期为2014年6月5日至2015年6月30日。

9.4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其主要管理人员的经营情况

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1200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86.03%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(安联资本投资有限公司),持有股份14.97%。

截至本报告期末,国寿安保基金管理有限公司共管理10只开放式基金,包括4只货币型基金、4只股票型基金及2只债券型基金,公募基金管理资产规模372.31亿元。

4.1.2 基金经理或基金经理助理及其他基金经理情况

4.1.3 任本基金基金经理的人员情况

报告期内,本基金基金经理通过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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金基金经理通过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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金基金经理通过各环节严格控制交易公平执行,且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日交易或连续的双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经营情况的说明

报告期内,本基金基金经理通过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。

4.5 管理人对宏观经济、国际市场及行业走势的展望

报告期内,本基金基金经理通过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。

4.6 管理人对报告期内基金业绩表现的说明

报告期内,本基金基金经理通过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。

4.7 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

本基金报告期内未进行份额申购、赎回。

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

4.9 报告期内基金管理人遵守信义原则的情况

在报告期内,基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金管理业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定的责任,日常估值由基金管理人与基金托管人共同进行。基金管理人和基金托管人严格按照基金合同的约定,各自履行自身的职责,保证估值的准确性和及时性,并就基金估值的计算方法和计算结果向基金托管人报告。

2015年上半年部分时间市场震荡,股市相关的风险不断累积。进入6月中下旬指数回调,杠杆投资者的出货引起一定的恐慌下跌,股市波动加剧,随着政府出台一系列限制市场的政策,市场将逐步恢复正常。在国内经济转型升级的大背景下,股市将逐步恢复正常。

本基金将严格遵守基金合同,以量化分析为基础,不断优化改进投资方案,力争将对标的指数业绩基准的误差控制降到最低程度。

4.10 管理人对本基金估值政策和方法的说明

本基金估值政策和方法遵循《证券投资基金会计核算办法》(以下简称“估值办法”)。

本基金估值方法的确定遵循相关法律法规的规定,并符合基金合同的约定。

本基金估值方法的确定遵循相关法律法规的规定,并符合基金