

国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日
基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国银行银行股份有限公司

§ 1 重要提示
基金管理人的董事、监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...

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...

估值水平已达到较低水平,估值的吸引力有显著提升,今后将对这类公司进行深入研究...

4.6 管理人对于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》...

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债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议...

4.7 管理人对于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 报告期内管理人对于本基金持有人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信守诺情况声明
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵信守信、净值计算、利润分配等情况的说明

6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金

6.2 利润表
会计主体:国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

6.4 关联方关系
6.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
6.4.2 本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.4.3 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.4 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.5 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.6 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.7 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.8 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.9 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.10 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.11 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.12 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.13 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.14 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.15 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.16 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.17 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.18 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.19 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.20 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.21 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.22 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.23 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.24 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.25 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.26 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.27 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.28 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.29 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.30 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.31 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.32 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.33 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.34 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.35 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.36 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.37 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.38 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.39 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.40 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.41 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.42 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.43 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.44 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.45 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.46 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.47 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.48 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.49 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.50 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.51 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.52 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.53 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.54 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.55 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.56 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.57 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.58 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.59 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.60 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.61 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.62 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.63 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.64 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.65 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.66 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.67 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.68 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.69 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.70 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.71 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.72 本报告期与基金发生关联交易的各方

6.4.73 本报告期与基金发生关联交易的各方
6.4.74 本报告期与基金发生关联交易的各方

准于国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金的批复(国寿安保基金[2016]113号)正式生效...

6.4.7.1 销售服务费
无。

6.4.7.2 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。

6.4.7.3 各关联方投资本基金的情况
6.4.7.3.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.7.3.2 报告期内未持有本基金的情况
6.4.7.3.3 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

6.4.7.4 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

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行约定利率计息。

6.4.7.5 本基金在承销期参与关联方承销证券的情况
本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.6 其他关联方事项的说明
本基金本报告期未发生其他关联交易事项。

6.4.8 利润分配情况
本基金于报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.9.3.3 其他
7 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
金额单位:人民币元

7.3 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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 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

7.4.2 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

7.4.3 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

7.4.4 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.5 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

7.4.6 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.7 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

7.4.8 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.9 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

7.4.10 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.11 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

7.4.12 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.13 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

7.4.14 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.15 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

7.4.16 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.17 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

7.4.18 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.19 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

7.4.20 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.21 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

7.4.22 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.23 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

7.4.24 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.25 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

7.4.26 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.27 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

7.4.28 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.29 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

E 为前一日基金资产净值
6.4.7.1.3 销售服务费
无。

6.4.7.2 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。

6.4.7.3 各关联方投资本基金的情况
6.4.7.3.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.7.3.2 报告期内未持有本基金的情况
6.4.7.3.3 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

6.4.7.4 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

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管,按银行约定利率计息。

6.4.7.5 本基金在承销期参与关联方承销证券的情况
本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.7.6 其他关联方事项的说明
本基金本报告期未发生其他关联交易事项。

6.4.8 利润分配情况
本基金于报告期内未进行利润分配。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.9.3.3 其他
7 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
金额单位:人民币元

7.3 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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 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

7.4.2 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

7.4.3 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

7.4.4 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.5 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

7.4.6 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.7 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

7.4.8 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.9 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

7.4.10 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.11 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

7.4.12 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.13 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

7.4.14 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.15 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

7.4.16 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.17 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

7.4.18 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.19 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

7.4.20 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.21 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

7.4.22 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.23 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

7.4.24 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.25 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

7.4.26 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.27 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

7.4.28 卖出股票的成本总额及买入股票的收入总额
单位:人民币元

7.4.29 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

7.4.30 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

7.8 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

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 本基金本报告期投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案稽查和在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资前十名股票未超出基金合同的投资范围。
7.12.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

7.12.4 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。

7.12.5 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中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
份额单位:份

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
8.3 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的情况

§ 9 开放式基金份额变动
单位:份

§ 10 重大事件揭示
10.1 基金份额持有人大会
10.2 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

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼
10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
10.7.1 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

10.7.2 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

10.8 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

10.9 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

10.10 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

10.11 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

10.12 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

10.13 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

10.14 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

10.15 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