国寿安保成长优选股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保成长优选股票
交易代码	001521
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月11日
报告期末基金份额总额	469,251,733.38份
投资目标	在深入研究的基础上,自下而上精选具有良好持续成长潜力的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金秉持聚焦型基金,因而在基金资产的投资管理上,将主要着力于权益类资产的配置,具体到权益类资产的行业配置和个股选择的投资方法上,将深入研究产业发展的内在规律,力争前瞻性的判断产业发展的趋势和方向,从产业视角指导中观行业配置,在进一步进行行业分析和比较的前提下,配置符合产业趋势和规律的行业;在优选行业配置的前提下,在具体股票池的选择上,将运用定性和定量相结合的选股方式,通过严谨的基本面分析和持续深入的跟踪调研,评估公司的经营、财务、竞争力以及公司治理等综合能力,精选兼具良好财务品质和持续盈利增长潜力的上市公司股票。此外,尽管某色行业从趋势上已经步入衰退周期,但其中的某些细分行业和领域可能由于新的商业模式的引入或者新的技术要素的加入,通过创新谋求转型后也可能会迎来新的发展阶段,我们也不排除对这些细分行业和领域的公司进行相应的投资。在债券类资产的投资上,将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X 80%+中债综合指数收益率(全价)X 20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中的高风险/高收益品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	1,550,565.78
2.本期利润	-56,030,451.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1162
4.期末基金资产净值	438,042,903.31
5.期末基金份额净值	0.933

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 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	-11.06%	1.44%	-1.44%	1.09%	-9.62%	0.35%

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

注:本基金基金合同生效日为2015年12月11日,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。图示日期为2015年12月11日至2018年9月30日。

§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
		任职日期	离任日期		
张琦	股票投资总监、股票投资部总监及基金经理	2015年12月11日	-	13年	2005年1月至2015年5月,任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理等职,2015年6月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监,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、国寿安保目标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保健康科学混合型证券投资基金、国寿安保消费新蓝海灵活配置混合型证券投资基金及国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张标	基金经理	2018年4月4日	-	4年	张标先生,博士研究生,2014年加入国寿安保基金,历任行业研究员、基金经理助理,现任国寿安保成长优选股票型证券投资基金基金经理。

注:任职日期为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。

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》、《国寿安保成长优选股票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 公平交易专项说明

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。

4.3.2 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

1、市场回顾

三季度以来,全球宏观经济延续上半年态势,美国复苏力度强于欧洲等主要经济体。美国经济延续较强的复苏态势,通胀预期回升,加息预期进一步强化和明确,美国无风险利率的上行对非美市场尤其是新兴市场国家和地区的金融市场形成了压力。与此同时,由于美国单边主义和贸易保护主义的抬头,全球贸易格局面临新的挑战。尤其是由于美国一再施压,中美贸易摩擦进一步加剧,全球贸易和经济的前景面临更多不确定性因素。从国内情况来看,宏观经济延续温和回落态势。主动去杠杆进一步深化,社会融资增速下行,投资增速面临一定压力。由于复杂的内外部形势的变化,国内政策基调出现了微调,结构性改革的预期进一步加强。

三季度,由于经济增长先行指标温和回落、企业盈利增长承压、加之中美贸易摩擦持续发酵等多重因素的影响,国内A股市场继续承压,指数表现出现明显分化。上证综指下跌0.92%,深圳成指下跌10.4%,沪深300下跌2.5%,中证100上涨1.12%,创业板综指下跌11.8%。三季度跌幅居前的行业为家电、纺织服装、医药生物等;三季度表现较好的行业为银行、非银金融、国防军工等。

2、运行分析

2018年三季度,国寿安保成长优选基金延续并坚持了偏向成长风格的配置特征。在组合管理上,向基本面扎实、成长前景明确的优质企业进行集中,以期穿越市场周期的影响。从行业配置上,电子、建材、电新、化工等行业配置比例较高,从风格特征上,组合配置整体偏向大制造相关的个股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.933元;本报告期基金份额净值增长率为-11.06%,业绩比较基准收益率为-1.44%。

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	390,778,642.28	88.99
	其中:股票	390,778,642.28	88.99
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	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	48,170,062.85	10.97
8	其他资产	187,376.87	0.04
9	合计	439,136,082.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	358,679,734.84	81.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,149.99	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,111,600.00	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	13,259,471.40	3.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,693,686.05	2.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	390,778,642.28	89.21

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

5.3 报告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

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	603899	晨光文具	630,100	19,564,605.00	4.47
2	600176	中国巨石	1,842,624	19,550,240.64	4.46
3	300408	三环集团	877,200	18,236,988.00	4.16
4	600031	三一重工	2,000,000	17,760,000.00	4.05
5	002138	顺络电子	1,070,663	17,665,939.50	4.03
6	002372	伟星新材	1,153,415	17,093,610.30	3.90
7	600563	法拉电子	340,000	15,058,600.00	3.44
8	603989	艾华集团	649,843	14,744,937.67	3.37
9	600486	扬农化工	300,000	13,908,000.00	3.18
10	601636	旗滨集团	3,276,500	13,499,180.00	3.08

5.4 报告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。

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。

5.6 报告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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 基金投资前十名股票未超出基金合同的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,240.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,633.52
5	应收申购款	140,503.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	187,376.87

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情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限制的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,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:份

报告期期初基金份额总额	493,010,645.64
报告期间基金总申购份额	5,574,978.64
减:报告期期间基金总赎回份额	29,333,890.90
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	469,251,733.38

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701~20180930	222,323,526.08	-	-	222,323,526.08	47.38%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。

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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保成长优选股票型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保成长优选股票型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保成长优选股票型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保成长优选股票型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

9.3.3 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
2018年10月25日

国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年9月24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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保强国智造灵活配置混合
交易代码	003131
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月27日
报告期末基金份额总额	65,554,933.69份
投资目标	本基金通过挖掘中国经济结构转型和产业升级大背景下,强国智造主题相关行业的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票及债券投资外,本基金还可通过投资衍生工具等,进一步为基金组合规避风险、增强收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高收益/风险品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	1,090,295.54
2.本期利润	-5,482,692.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0832
4.期末基金资产净值	59,428,183.07
5.期末基金份额净值	0.9065

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。

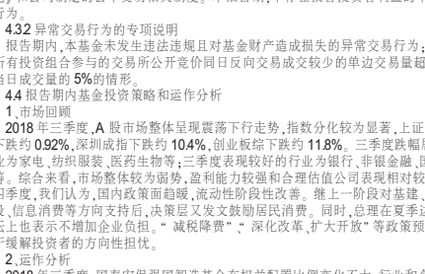
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-8.44%	1.48%	-0.56%	0.81%	-7.88%	0.67%

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



注:本基金的基金合同于2016年9月27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。

§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
		任职日期	离任日期		
李捷	基金经理	2016年9月27日	-	11年	李捷先生,硕士。曾任德勤华永会计师事务所高级审计师,中国国际金融有限公司分析员,财富思品证券有限责任公司投资分析师。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理。现任国寿安保体本混合型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳瑞混合型证券投资基金及国寿安保华兴灵活配置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》、《国寿安保强国智造灵活配置混合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 公平交易专项说明

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。

4.3.2 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

1、市场回顾

2018年三季度,A股市场整体呈现震荡下行走势,指数分化较为显著,上证综指累计下跌约0.92%,深圳成指下跌约10.4%,创业板综下跌约11.8%。三季度跌幅居前的行业为家电、纺织服装、医药生物等;三季度表现较好的行业为银行、非银金融、国防军工等。综合来看,市场整体较为弱势,盈利能力较强和合理估值公司表现相对较好。展望四季度,我们认为,国内政策面趋暖,流动性阶段性改善。继上一阶段对基建、新农村建设、信息消费等方向支持后,决策层又发文鼓励居民消费。同时,总理在夏季达沃斯论坛上也表示不增加企业负担。"减税降费"、"深化改革、扩大开放"等政策预期,有利于缓解投资者的方向性担忧。

2、运作分析

2018年三季度,国寿安保强国智造基金在权益配置比例变化不大,行业和个股结构上略有调整,整体维持配置优质公司的思路。基金组合的配置整体仍偏向制造业及其相关领域。在行业配置上,配置比例相对较高的有电子、食品饮料、家电、电气设备、化工、汽车、电气设备、建材、机械设备等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9065元;本报告期基金份额净值增长率为-8.44%,业绩比较基准收益率为-0.56%。

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	52,173,194.13	87.09
	其中:股票	52,173,194.13	87.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,436,963.30	7.41
	其中:债券	4,436,963.30	7.41
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,600,000.00	2.67
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,596,920.14	2.67
8	其他资产	101,547.16	0.17
9	合计	59,908,624.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,333,250.00	3.93
C	制造业	40,910,922.76	68.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	549,000.00	0.92
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	630,200.00	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,168,288.00	1.97
J	金融业	2,967,040.00	4.99
K	房地产业	900,580.00	1.52
L	租赁和商务服务业	351,573.82	0.59
M	科学研究和技术服务业	538,879.55	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	322,260.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	1,501,200.00	2.53
S	综合	-	-
	合计	52,173,194.13	87.79

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告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

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	600031	三一重工	280,000	2,486,400.00	4.18
2	600887	伊利股份	88,000	2,259,840.00	3.80
3	600741	华域汽车	90,000	2,025,000.00	3.41
4	600176	中国巨石	180,000	1,909,800.00	3.21
5	002415	海康威视	60,000	1,724,400.00	2.90
6	600498	烽火通信	56,000	1,671,040.00	2.81
7	600703	三安光电	100,000	1,636,000.00	2.75
8	601088	中国神华	75,000	1,529,250.00	2.57
9	601877	正泰电器	66,000	1,520,640.00	2.56
10	002739	万达电影	67,500	1,501,200.00	2.53

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,910.00	0.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,068,300.00	5.16
	其中:政策性金融债	3,068,300.00	5.16
4	企业债券	756,731.50	1.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	512,021.80	0.86
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,436,963.30	7.47

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	30,500	3,068,300.00	5.16
2	122187	12晚纤债	5,470	554,931.50	0.93
3	113015	隆基转债	2,490	242,476.20	0.41
4	122147	12华新02	2,000	201,800.00	0.34
5	113504	艾华转债	1,380	156,464.40	0.26

5.6 报告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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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。

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开谴责、处罚。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,047.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	84,990.33
5	应收申购款	509.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,547.16

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113015	隆基转债	242,476.20	0.41
2	113504	艾华转债	156,464.40	0.26

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002739	万达电影	1,501,200.00	2.53	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:份

报告期期初基金份额总额	66,907,130.92
报告期间基金总申购份额	151,548.51
减:报告期期间基金总赎回份额	1,503,745.74
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	65,554,933.69

注:报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701~20180930	18,194,141.19	-	-	18,194,141.19	27.75%
	2	20180701~20180930	20,408,000.00	-	-	20,408,000.00	31.13%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。

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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

9.3.3 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
2018年10月25日

国寿安保智慧生活股票型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月25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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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,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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保智慧生活股票
交易代码	001672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月1日
报告期末基金份额总额	425,140,464.93份
投资目标	本基金在深入研究的基础上,自下而上精选开拓和建设智慧生活的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票投资策略外,本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略,进一步为基金组合规避风险、增强收益。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在债券类资产的投资上,将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X 80%+中债综合指数收益率(全价)X 20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中的高风险/高收益品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,495,303.47
2.本期利润	-40,988,614.54
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0947
4.期末基金资产净值	405,599,244.18
5.期末基金份额净值	0.954

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 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