

国寿安保沪深300指数型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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

报告送出日期:2015年07月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司对本基金的定期报告予以复核。于2015年07月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值增长率和偏离度等项数据,确认不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺在公告前不出现影响基金资产净值的情形,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。

基金合同中关于费用的约定。

本报告期自2015年04月01日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国寿安保沪深300指数

基金主代码 000013

基金运作方式 紧密跟踪开放式

基金合同生效日 2014年10月06日

报告期末基金份额总额 407,430,138份

货币市场基金

基金类别 指数型

基金规模 407,430,138份

基金总资产 407,430,138元

基金总负债 407,430,138元

基金份额净值 1.000元

基金份额净值增长率 0.0%

基金份额净值增长率标准差 0.0%

业绩比较基准 沪深300指数×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,属于较高风险、较高预期收益的投资品种。本基金将主要投资于沪深300指数成份股,并结合对宏观经济形势、行业景气度、个股基本面等的分析,精选具有投资价值的股票进行配置,力争在风险调整后的收益上超越沪深300指数,同时力求控制风险,降低波动率,追求基金资产的长期稳定增值。

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

§ 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(2015年04月01日-2015年06月30日)

1.本期已实现收益 661,372,587.06

2.本期利润 280,555,696.79

3.期初至报告期末的利润累积 0.0364

4.期末基金资产净值 782,578,047.69

5.期末基金份额净值 1.0208

注:本期已实现收益扣减基金到期利息收入、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,本期利润为期末至本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金指标不包括持有人交易基金的各项费用,以费用后用于投资人实际收益水平要低于所列示的金额。

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 ① 净值增长差 ② 业绩比较 ③ 业比较基准 ④ 准收益率差 ⑤ ①-③ ②-④

过去三个月 11.16% 2.22% 0.98% 2.49% 1.18% 0.04%

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

图:国寿安保沪深300指数型证券投资基金2015年第二季度净值增长率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,图示日期为2014年6月5日至2015年6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 任职日期 离任日期 说明

吴坚 基金经理 2014年06月05日 - 8年 先任硕士,博士研究生,曾任中国建设银行总行公司金融部、中国农银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,同时担任国寿安保货币基金经理。

李旗 基金经理 2015年03月20日 - 5年 李先生,博士研究生,2009年10月在中行总行金融市场部工作,2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司,历任基金经理助理、研究员、基金经理,现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金经理,同时担任国寿安保货币基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日或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 管理人对报告期内基金运作的说明

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》及其他有关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理运作基金资产,在严格控制风险的基础上,努力为投资人谋取最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,不存在违反基金合同和基金经理持有人利益的行为。

4.3 公公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易的执行情况

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 异常交易的专项说明

报告期内,本基金未发生过涉及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 报告期内本基金的报备情况和运作分析

报告期内,本基金严格遵守基金合同,紧密跟踪标的,将年化跟踪误差和日均绝对跟踪偏离度控制在基金合同约定的范围内。

本基金的报备情况良好,先涨停后跌行情。本基金在基金合同允许的范围内保持合适仓位,力争取得与业绩基准相一致的收益。

4.5 报告期内本基金的分红情况

4.5.1 公平交易专项说明

4.5.2 报告期内本基金存在不公平交易的情况说明

4.5.3 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.4 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.5 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.6 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.7 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.8 报告期内本基金不存在关联交易的情况

4.5.9 报告期内本基金不存在利用未公开信息交易的情况

4.5.10 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.11 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.12 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.13 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.14 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.15 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.16 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.17 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.18 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.19 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.20 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.21 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.22 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.23 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.24 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.25 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.26 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.27 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.28 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.29 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.30 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.31 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.32 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.33 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.34 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.35 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.36 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.37 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.38 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.39 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.40 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.41 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.42 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.43 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.44 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.45 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.46 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.47 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.48 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.49 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.50 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.51 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.52 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.53 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.54 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.55 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.56 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.57 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.58 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.59 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.60 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.61 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.62 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.63 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.64 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.65 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.66 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.67 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.68 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.69 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.70 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.71 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.72 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.73 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.74 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.75 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.76 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.77 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.78 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.79 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.80 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.81 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.82 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.83 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.84 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.85 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.86 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.87 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.88 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.89 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.90 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.91 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.92 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.93 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.94 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.95 报告期内本基金不存在不公平交易的情况

4.5.96 报告期内本基金不存在内幕交易的情况

4.5.97 报告期内本基金不存在不公平对待不同客户的情况

4.5.98 报告期内本基金不存在利益输送的情况

4.5.99 报告期内本基金不存在不公平交易的情况