

2017年12月31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
报告送出日期:2018年1月20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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年01月19日复核了报告中的财务指标、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2017年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国寿安保沪深300指数型证券投资基金

交易代码 000613

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2014年6月5日

报告期末基金份额总额 653,733,610.84份

基金总资产 3,985,000,000.00元

基金总负债 -3,985,000,000.00元

报告期末基金份额净值 1.018元

基金份额净值增长率 3.98%

基金份额净值增长率标准差 4.62%

风险收益特征 本基金为股票型基金，属于高风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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 2017年10月1日-2017年12月31日

1.本期实现收益 20,946,165.00

2.本期利润 36,522,850.45

3.加权平均基金份额利润 0.0539

4.期末基金资产净值 681,398,116.32

5.期末基金份额净值 1.018

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,计人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 本基金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 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.98% 0.74% 4.62% 0.76% -0.04% -0.02%

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: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

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,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

国寿安保沪深300指数型证券投资基金

2017年第四季度报告

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

报告期内,本基金严格遵守基金合同,紧密跟踪标的指数,通过指数基金相对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,以为投资者带来稳定回报和收取相对应的管理费用。在正常市场情况下,本基金力争在扣除管理费用和托管费用后,跟踪误差不超过0.35%,跟踪误差不超过4%。

本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2017年10月1日起至12月31日止。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

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	601318	中国平安	576,117	40,316,667.66	5.92
2	600519	招商银行	27,204	18,974,517.96	2.78
3	600036	招商银行	16,057,752.68	2.36	
4	000333	深万科A	232,202	12,870,956.86	1.89
5	000651	格力电器	15,226	11,232,036.20	1.65
6	600016	民生银行	1,306,200	10,959,018.00	1.61
7	601166	兴业银行	637,135	10,824,923.65	1.59
8	600887	伊利股份	322,200	10,371,618.00	1.52
9	601398	工银瑞信	1,515,200	9,394,240.00	1.38
10	600485	恒泰艾普	565,100	9,058,553.00	1.33

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

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农、林、牧、渔业	1,387,128.00	0.20
2	采矿业	19,872,432.46	2.92
3	制造业	262,499,995.28	38.62
4	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,669,933.50	2.45
5	建筑业	23,838,861.84	3.50
6	批发和零售业	12,836,122.39	1.88
7	银行存款和结算备付金合计	33,728,801.07	4.92
8	其他资产	1,202,631.51	0.18
9	合计	685,033,727.69	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.3 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.4 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.5 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.6 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.7 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.8 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.9 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.10 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.11 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.12 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.13 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.14 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.15 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.16 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.17 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.18 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.19 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.20 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.21 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.22 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.23 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.24 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.25 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.26 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.27 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.28 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.29 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.30 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.31 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.32 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.33 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.34 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.35 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.36 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.37 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.38 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.39 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.40 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.41 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.42 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.43 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.44 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.45 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.46 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.47 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.48 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.49 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.50 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.51 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.52 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.53 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.54 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.55 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.56 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.57 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.58 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.59 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.60 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.61 报告期末按行业分类的境内股票投资组合