

国寿安保沪深300指数型证券投资基金

2014年第3季度报告

2014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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2014年10月27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的基金合同规定，于2014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2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保沪深300指数
基金主代码	000613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年6月5日
报告期末基金份额总额	1,318,967,015.16份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于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，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。在正常市场情况下，本基金力争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0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金采取完全复制策略，即按照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（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）导致基金无法获得足够数量的股票时，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，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×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，跟踪标的指数市场表现，是股票型基金中处于中等风险水平的基金产品。
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（2014年07月01日-2014年09月30日）
1. 本期已实现收益	24,757,277.07
2. 本期利润	95,355,644.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0567
4. 期末基金资产净值	1,419,923,176.18
5. 期末基金份额净值	1.0765

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。

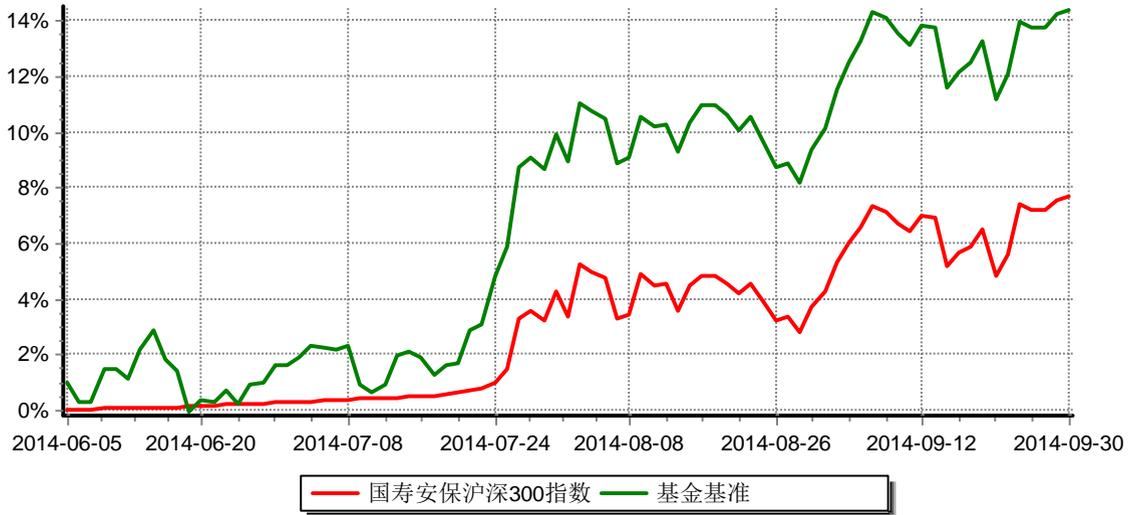
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	7.35%	0.66%	12.52%	0.85%	-5.17%	-0.19%

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第十二部分“（三）投资范围”、“（五）投资限制”的有关规定。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 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		
吴坚	基金经理	2014年6月5日	—	7年	吴坚先生，博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理、中国人寿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。
--	--	--	--	--	-------

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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保沪深300指数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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年3季度，宏观经济增长放缓，消费平稳增长，固定资产投资增速有所下降，但在外部经济逐渐恢复背景下，出口表现较好，对GDP拉动作用进一步增强。同时，结构性减税、定向再贷款等政策相继出台，国企改革继续推进。在大盘指数已经处于历史低位，以及沪港通等政策措施推动下，股票市场资金流入增加，沪深300指数明显回升。基于对宏观经济和市场的判断，我们紧紧抓住市场机会，加快了建仓节奏，有效降低了建仓期内与标的指数的跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金仍处于建仓期内。截至2014年9月30日，本基金份额净值为1.0765，累计份

额净值为1.0765。报告期内净值增长率为7.35%，同期业绩基准涨幅为12.52%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，美国经济复苏趋势明朗，随着QE政策逐步退出，需密切关注全球流动性变化。国内宏观经济增长将延续三季度势头，通胀水平将有所上升，但仍处于政府目标范围内。改革仍然是推动经济增长的重要动力，宏观经济政策将围绕“稳增长 调结构”展开。随着沪港通等一系列政策预期的兑现，预计指数波动将有所加大。

§ 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	1,334,657,329.43	93.80
	其中：股票	1,334,657,329.43	93.80
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	86,528,380.50	6.08
8	其他各项资产	1,720,412.05	0.12
9	合计	1,422,906,121.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	5,492,145.00	0.39
B	采矿业	82,726,422.25	5.83
C	制造业	496,791,004.97	34.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,385,494.45	3.69
E	建筑业	43,085,120.37	3.03
F	批发和零售业	38,859,331.40	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	35,729,335.00	2.52
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,703,330.31	3.15
J	金融业	434,431,327.93	30.60
K	房地产业	60,949,689.92	4.29
L	租赁和商务服务业	13,685,387.83	0.96
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	7,317,009.00	0.52
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	11,257,370.00	0.79
S	综合	7,244,361.00	0.51
	合计	1,334,657,329.43	94.00

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	601318	中国平安	1,163,700	48,107,358.00	3.39
2	600036	招商银行	3,970,900	41,257,651.00	2.91
3	600016	民生银行	6,523,707	40,707,931.68	2.87
4	601166	兴业银行	2,737,700	27,979,294.00	1.97

5	600000	浦发银行	2,687,700	26,205,075.00	1.85
6	600030	中信证券	1,879,600	25,036,272.00	1.76
7	601398	工商银行	6,311,800	22,280,654.00	1.57
8	000002	万科A	2,324,800	21,341,664.00	1.50
9	600837	海通证券	1,942,000	20,041,440.00	1.41
10	600519	贵州茅台	109,904	17,818,735.52	1.25

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除中国平安外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。

中国平安于2013年10月14日公告称，集团控股子公司平安证券收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48号），中国证监会决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收

入人民币2,555万元，并处以人民币5,110万元的罚款，暂停其保荐业务许可3个月。

本基金管理人对上述事项进行了分析，认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述投资判断未发生改变。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	495,631.67
2	应收证券清算款	1,199,150.95
3	应收股利	—
4	应收利息	24,523.05
5	应收申购款	1,106.38
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,720,412.05

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不存在流通受限情况。

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	3,789,275,989.79
-------------	------------------

报告期期间基金总申购份额	294,686,552.46
减：报告期期间基金总赎回份额	2,764,995,527.09
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	1,318,967,015.16

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内基金管理人未投资本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准国寿安保沪深300指数型证券投资基金募集的文件

8.1.2 《国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金合同》

8.1.3 《国寿安保沪深300指数型证券投资基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.1.5 报告期内国寿安保沪深300指数型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

8.1.6 中国证监会要求的其他文件

8.2 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17号中国人寿中心17层

8.3 查阅方式

8.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

8.3.3 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

二〇一四年十月二十七日