

# 国寿安保沪深300指数型证券投资基金

## 2015年半年度报告

### 2015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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015年8月28日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2015年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 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	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
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	43
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
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情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45

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 .....	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4	基金投资策略的改变 .....	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况 .....	45
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8	其他重大事件 .....	46
<b>§ 11</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
11.1	备查文件目录 .....	48
11.2	存放地点 .....	48
11.3	查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深300指数型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	407,430,138.87份

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张彬	林葛
	联系电话	010-50850744	010-66060069

电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	4009-258-258	95599
传真	010-50850776	010-68121816
注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢306号	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层	北京复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码	100033	100031
法定代表人	刘慧敏	刘士余

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2015年01月01日-2015年06月30日）
本期已实现收益	709,841,737.47
本期利润	522,417,093.94
加权平均基金份额本期利润	0.5334
本期加权平均净值利润率	31.09%
本期基金份额净值增长率	26.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015年06月30日）
期末可供分配利润	375,147,908.82
期末可供分配基金份额利润	0.9208

期末基金资产净值	782,578,047.69
期末基金份额净值	1.9208
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2015年06月30日）
基金份额累计净值增长率	92.08%

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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-8.33%	3.31%	-7.18%	3.32%	-1.15%	-0.01%
过去三个月	11.16%	2.52%	9.98%	2.48%	1.18%	0.04%
过去六个月	26.30%	2.17%	25.29%	2.15%	1.01%	0.02%
过去一年	91.54%	1.74%	99.67%	1.75%	-8.13%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今（2014年6月5日-2015 年6月30日）	92.08%	1.68%	102.96%	1.70%	-10.88%	-0.02%

#### 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2014年6月5日至2015年6月30日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准，于2013年10月29日设立，公司注册资本5.88亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，持有股份85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（安保资本投资有限公司），持有股份14.97%。

截至本报告期末，国寿安保基金管理有限公司共管理10只开放式基金，包括4只货币型基金、4只股票指数型基金及2只债券型基金，公募基金资产管理规模372.31亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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	—	8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及国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金经理。
李康	基金经理	2015年3月20日	—	5年	李康先生，博士研究生。2009年10月至2012年12月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012年12月至2013年11月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深300指数型证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金及国寿安

					保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------------

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《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 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，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差主要源自申购赎回、标的成份股中国人寿和农业银行的替代投资。成份股停牌和调整等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

##### 4.4.2 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1.9208元，累计份额净值为1.9208元。报告期内净值增长率为26.30%，同期业绩基准涨幅为25.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年上半年大部分时间市场延续上涨势头，相应的风险不断累积。进入6月中下

旬指数回调，杠杆投资的退出引起一定的恐慌性下跌，市场波动加剧。随着政府出台一系列稳定市场的政策，市场将逐步恢复正常。在国内经济转型和改革的大背景下，调整之后市场将迎来新的投资机会。

本基金将严格遵守基金合同，以量化分析为基础，不断优化改进投资方案，力争将对标的指数业绩基准的跟踪误差降低到最小程度。

#### 4.6 管理人对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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。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央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对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 报告期内管理人对本基金持有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规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人国寿安保基金管理有限公司2015年1月1日至2015年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为, 国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为, 国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：国寿安保沪深300指数型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	45,608,934.04	52,211,899.01
结算备付金		50,087.34	46,866.69
存出保证金		569,286.29	710,644.92
交易性金融资产	6.4.6.2	739,163,914.85	1,831,226,662.00
其中：股票投资		739,163,914.85	1,781,156,662.00
基金投资		—	—
债券投资		—	50,070,000.00
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
应收证券清算款		1,162,865.45	—
应收利息	6.4.6.5	9,515.75	812,339.97
应收股利		—	—

应收申购款		110,195.75	1,143,804.10
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.6.6	—	—
资产总计		786,674,799.47	1,886,152,216.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年06月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.6.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		2,294,790.40	2,424,448.94
应付管理人报酬		357,684.12	614,878.83
应付托管费		71,536.81	122,975.78
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.6.7	1,042,722.29	859,510.99
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.8	330,018.16	212,980.29
负债合计		4,096,751.78	4,234,794.83
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.6.9	407,430,138.87	1,237,491,250.57
未分配利润	6.4.6.10	375,147,908.82	644,426,171.29
所有者权益合计		782,578,047.69	1,881,917,421.86
负债和所有者权益总计		786,674,799.47	1,886,152,216.69

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值人民币1.9208元，基金份额总额407,430,138.87份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深300指数型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年01月01日 -2015年06月30日	上年度可比期间 2014年06月05日-2014年 06月30日
<b>一、收入</b>		530,898,218.40	15,803,452.72
1. 利息收入		1,059,635.22	14,124,634.21
其中：存款利息收入	6.4.6.11	228,949.81	9,662,673.63
债券利息收入		830,685.41	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	4,461,960.58
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		715,167,063.03	—
其中：股票投资收益	6.4.6.12	708,125,262.55	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.13	520,677.73	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.14	—	—
股利收益	6.4.6.15	6,521,122.75	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	-187,424,643.53	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	2,096,163.68	1,678,818.51
<b>减：二、费用</b>		8,481,124.46	2,918,577.35
1. 管理人报酬		4,181,083.09	2,369,661.49
2. 托管费		836,216.57	450,021.24
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.6.18	3,083,724.74	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.6.19	380,100.06	98,894.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		522,417,093.94	12,884,875.37
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填</b>		522,417,093.94	12,884,875.37

列)			
----	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保沪深300指数型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,237,491,250.57	644,426,171.29	1,881,917,421.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	522,417,093.94	522,417,093.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-830,061,111.70	-791,695,356.41	-1,621,756,468.11
其中：1. 基金申购款	33,341,110.74	22,143,799.25	55,484,909.99
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-863,402,222.44	-813,839,155.66	-1,677,241,378.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	407,430,138.87	375,147,908.82	782,578,047.69
项 目	上年度可比期间 2014年06月05日-2014年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,130,087,968.40	—	5,130,087,968.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	12,884,875.37	12,884,875.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,340,811,978.61	-2,224,658.53	-1,343,036,637.14
其中：1. 基金申购款	16,842.67	36.27	16,878.94
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,340,828,821.28	-2,224,694.80	-1,343,053,516.08

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	3,789,275,989.79	10,660,216.84	3,799,936,206.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

左季庆

左季庆

韩占锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保沪深300指数型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]376号文《关于核准国寿安保沪深300指数型证券投资基金募集的批复》的核准,由国寿安保基金管理有限公司于2014年5月8日至2014年5月30日向社会公开发行人募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2014)验字第61090605\_02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年6月5日正式生效,首次设立募集规模为5,130,087,968.40份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为指数型证券投资基金,这也是业内今年首只以沪深300指数为投资标的的指数基金。国寿安保沪深300指数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。本基金投资范围主要为标的指数成份股(蓝筹股)及备选成份股,所持有的股票资产占基金资产的比例不低于90%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基

金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015年6月30日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

##### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）的有关规定，国寿安保基金管理有限公司经与基金托管人、会计师事务所协商一致，自2015年3月30日起对旗下证券投资基金持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于2015年3月30日，相关调整对本基金前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

##### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.5 税项

##### 6.4.5.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 6.4.5.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收

入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 6.4.5.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
活期存款	45,608,934.04
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	45,608,934.04

#### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	478,060,135.01	739,163,914.85	261,103,779.84
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	—	—	—
交易所市场	—	—	—

	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	478,060,135.01	739,163,914.85	261,103,779.84

#### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
应收活期存款利息	9,237.15
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	22.50
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	256.10
合计	9,515.75

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,042,297.29
银行间市场应付交易费用	425.00

合计	1, 042, 722. 29
----	-----------------

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	8, 294. 39
审计费	39, 671. 58
信息披露费	206, 765. 71
应付指数使用费	75, 286. 48
合计	330, 018. 16

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年01月01日-2015年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1, 237, 491, 250. 57	1, 237, 491, 250. 57
本期申购	33, 341, 110. 74	33, 341, 110. 74
本期赎回（以“-”号填列）	-863, 402, 222. 44	-863, 402, 222. 44
本期末	407, 430, 138. 87	407, 430, 138. 87

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	109, 724, 253. 86	534, 701, 917. 43	644, 426, 171. 29
本期利润	709, 841, 737. 47	-187, 424, 643. 53	522, 417, 093. 94
本期基金份额交易产生的变动数	-338, 114, 835. 68	-453, 580, 520. 73	-791, 695, 356. 41
其中：基金申购款	6, 471, 332. 90	15, 672, 466. 35	22, 143, 799. 25
基金赎回款（以“-”号填列）	-344, 586, 168. 58	-469, 252, 987. 08	-813, 839, 155. 66
本期已分配利润	—	—	—
本期末	481, 451, 155. 65	-106, 303, 246. 83	375, 147, 908. 82

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年01月01日-2015年06月30日
活期存款利息收入	217,673.80
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	7,360.62
其他	3,915.39
合计	228,949.81

#### 6.4.6.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	708,125,262.55
股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	708,125,262.55

##### 6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
卖出股票成交总额	1,702,802,007.13
减：卖出股票成本总额	994,676,744.58
买卖股票差价收入	708,125,262.55

#### 6.4.6.13 债券投资收益

##### 6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	520,677.73
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	520,677.73

##### 6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	53,217,187.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	51,082,400.00
减：应收利息总额	1,614,110.07
买卖债券差价收入	520,677.73

#### 6.4.6.14 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

#### 6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,521,122.75
基金投资产生的股利收益	—
合计	6,521,122.75

#### 6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
1. 交易性金融资产	-187,424,643.53
——股票投资	-187,418,043.53
——债券投资	-6,600.00
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-187,424,643.53

#### 6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
基金赎回费收入	2,080,372.59
转换费收入	15,791.09
合计	2,096,163.68

#### 6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
交易所市场交易费用	3,083,299.74
银行间市场交易费用	425.00
合计	3,083,724.74

#### 6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,765.71
银行费用	6,219.49
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
指数使用费	167,243.28
其他	200.00
合计	380,100.06

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

##### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

#### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	基金托管人、代销机构
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	国寿安保的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	集团公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.9.2 关联方报酬

###### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月 30日	上年度可比期间 2014年06月05日-2014年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,181,083.09	2,369,661.49
其中：支付销售机构的客户维护费	45,529.51	65,897.38

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金合同生效日管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提；自2014年6月23日起，年费率变更为0.50%；计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

R为基金管理费年费率

###### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日-2015年06月 30日	上年度可比期间 2014年06月05日-2014年06月30 日
----	-----------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	836,216.57	450,021.24
----------------	------------	------------

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金合同生效日托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提；自2014年6月23日起，年费率变更为0.10%；计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

#### 6.4.9.3 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。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.9.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年06月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
集团公司	150,000,000.00	36.82%	400,000,000.00	32.32%
中国人寿	150,039,666.66	36.83%	644,761,950.70	52.10%

##### 6.4.9.5 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

关联方名称	本期 2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间 2014年06月05日-2014年06月30日	
	期末 余额	当期 存款利息收入	期末 余额	当期 存款利息收入
中国农业银行股 份有限公司	45,608,934.04	217,673.80	7,356.22	145,229.59

##### 6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.10 利润分配情况

##### 6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌开 盘单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
600153	建发股份	2015-06-29	重大资产重组	17.51		—	113,300	890,182.63	1,983,883.00
600277	亿利能源	2015-06-01	重要事项未公告	14.62		—	53,200	465,706.94	777,784.00
600395	盘江股份	2015-06-09	重要事项未公告	15.71	2015-08-19	14.00	31,600	270,620.51	496,436.00
600886	国投电力	2015-06-24	重要事项未公告	14.87		—	226,000	1,663,553.89	3,360,620.00
600900	长江电力	2015-06-15	重大资产重组	14.35		—	329,700	2,719,793.83	4,731,195.00
601021	春秋航空	2015-06-26	非公开发行	126.09	2015-07-21	113.48	3,800	521,149.00	479,142.00
601111	中国国航	2015-06-30	非公开发行	15.36	2015-07-29	13.78	113,500	590,617.19	1,743,360.00
601216	内蒙君正	2015-06-29	非公开发行	24.07	2015-07-02	24.20	40,900	397,360.69	984,463.00
601633	长城汽车	2015-06-19	非公开发行	42.76	2015-07-13	38.50	26,700	908,390.24	1,141,692.00
000024	招商地产	2015-04-03	重要事项未公告	36.43		—	200,700	2,946,367.31	7,311,501.00
000630	铜陵有色	2015-03-09	重要事项未公告	8.44		—	304,200	1,811,143.70	2,567,448.00
000709	河北钢铁	2015-06-30	重要事项未公告	7.00	2015-08-24	6.30	282,900	762,418.19	1,980,300.00
000778	新兴铸管	2015-06-15	非公开发行	12.96		—	145,600	707,484.66	1,886,976.00
000793	华闻传媒	2015-05-26	重要事项未公告	20.75		—	75,400	923,072.86	1,564,550.00

000839	中信国安	2015-06-29	重要事项未公告	23.57		—	62,600	600,451.87	1,475,482.00
000878	云南铜业	2015-06-08	重要事项未公告	24.50		—	45,000	485,837.12	1,102,500.00
000917	电广传媒	2015-05-28	重要事项未公告	42.89		—	45,100	745,292.74	1,934,339.00
000963	华东医药	2015-06-26	重要事项未公告	71.48	2015-08-05	69.20	14,400	785,197.72	1,029,312.00
002001	新和成	2015-06-30	拟筹划员工持股计划相关事项	17.09	2015-07-13	18.49	36,200	547,007.22	618,658.00
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重要事项未公告	37.85		—	53,600	862,614.87	2,028,760.00
002310	东方园林	2015-05-27	重大资产重组	38.30		—	25,600	444,639.31	980,480.00
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重要事项未公告	44.35		—	30,500	1,049,492.31	1,352,675.00
002375	亚厦股份	2015-06-17	拟筹划员工持股计划相关事项	29.21	2015-07-20	26.29	35,600	477,847.16	1,039,876.00
002416	爱施德	2015-05-05	重要事项未公告	20.67	2015-07-29	18.60	33,400	453,840.87	690,378.00

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

##### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金

均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注6.4.11中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资金额较小，因此基金净值受利率变动的影响较小。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2015年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,608,934.04	—	—	—	45,608,934.04
结算备付金	50,087.34	—	—	—	50,087.34
存出保证金	569,286.29	—	—	—	569,286.29

交易性金融资产	—	—	—	739,163,914 .85	739,163,914 .85
应收证券清算款	—	—	—	1,162,865.4 5	1,162,865.4 5
应收利息	—	—	—	9,515.75	9,515.75
应收申购款	—	—	—	110,195.75	110,195.75
资产总计	46,228,307. 67	—	—	740,446,491 .80	786,674,799 .47
负债					
应付赎回款	—	—	—	2,294,790.4 0	2,294,790.4 0
应付管理人报酬	—	—	—	357,684.12	357,684.12
应付托管费	—	—	—	71,536.81	71,536.81
应付交易费用	—	—	—	1,042,722.2 9	1,042,722.2 9
其他负债	—	—	—	330,018.16	330,018.16
负债总计	—	—	—	4,096,751.7 8	4,096,751.7 8
利率敏感度缺口	46,228,307. 67	—	—	736,349,740 .02	782,578,047 .69
上年度末2014年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	52,211,899. 01	—	—	—	52,211,899. 01
结算备付金	46,866.69	—	—	—	46,866.69
存出保证金	710,644.92	—	—	—	710,644.92
交易性金融资产	50,070,000. 00	—	—	1,781,156,6 62.00	1,831,226,6 62.00
应收利息	—	—	—	812,339.97	812,339.97
应收申购款	—	—	—	1,143,804.1 0	1,143,804.1 0
资产总计	103,039,410 .62	—	—	1,783,112,8 06.07	1,886,152,2 16.69
负债					
应付赎回款	—	—	—	2,424,448.9	2,424,448.9

				4	4
应付管理人报酬	—	—	—	614,878.83	614,878.83
应付托管费	—	—	—	122,975.78	122,975.78
应付交易费用	—	—	—	859,510.99	859,510.99
其他负债	—	—	—	212,980.29	212,980.29
负债总计	—	—	—	4,234,794.83	4,234,794.83
利率敏感度缺口	103,039,410.62	—	—	1,778,878,011.24	1,881,917,421.86

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年06月30日，本基金主要投资于权益类品种，因此市场利率因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，所持有的股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。于2015年6月30日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	739,163,914.85	94.45	1,781,156,662.00	94.65
交易性金融资产-债券投资	—	—	50,070,000.00	2.66
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	739,163,914.85	94.45	1,831,226,662.00	97.31

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1 假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变；		
假设	2 用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
假设	3 Beta系数是自2015年1月1日至2015年6月30日所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	+5%	39,057,595.41	91,561,333.10
	-5%	-39,057,595.41	-91,561,333.10

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.13.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币692,116,410.85元，属于第二层次的余额为人民币47,047,504.00元，无属于第三层次的余额。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

##### 6.4.13.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.13.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	739,163,914.85	93.96
	其中：股票	739,163,914.85	93.96
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	45,659,021.38	5.80
7	其他各项资产	1,851,863.24	0.24
8	合计	786,674,799.47	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,842,062.00	0.24
B	采矿业	31,863,492.70	4.07
C	制造业	249,747,774.70	31.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,683,229.00	3.92
E	建筑业	34,258,120.00	4.38
F	批发和零售业	16,327,665.00	2.09
G	交通运输、仓储和邮政业	27,012,548.00	3.45
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,402,583.64	5.03

J	金融业	243,849,496.00	31.16
K	房地产业	37,751,728.00	4.82
L	租赁和商务服务业	8,286,828.59	1.06
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	6,191,273.00	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	837,050.22	0.11
R	文化、体育和娱乐业	9,172,272.00	1.17
S	综合	1,937,792.00	0.25
	合计	739,163,914.85	94.45

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	359,800	29,482,012.00	3.77
2	600036	招商银行	1,099,400	20,580,768.00	2.63
3	600016	民生银行	1,805,800	17,949,652.00	2.29
4	600030	中信证券	524,300	14,108,913.00	1.80
5	601166	兴业银行	761,500	13,135,875.00	1.68
6	600000	浦发银行	712,300	12,080,608.00	1.54
7	600837	海通证券	539,100	11,752,380.00	1.50
8	601766	中国中车	610,710	11,212,635.60	1.43
9	000651	格力电器	160,300	10,243,170.00	1.31
10	601398	工商银行	1,880,200	9,927,456.00	1.27
11	000002	万科A	646,200	9,382,824.00	1.20
12	601328	交通银行	1,045,900	8,618,216.00	1.10
13	601668	中国建筑	999,300	8,304,183.00	1.06
14	601939	建设银行	1,130,400	8,059,752.00	1.03
15	600519	贵州茅台	30,400	7,832,560.00	1.00
16	600887	伊利股份	408,300	7,716,870.00	0.99
17	601988	中国银行	1,544,500	7,552,605.00	0.97
18	601601	中国太保	249,400	7,526,892.00	0.96
19	000024	招商地产	200,700	7,311,501.00	0.93

20	601989	中国重工	489,300	7,241,640.00	0.93
21	601818	光大银行	1,326,100	7,107,896.00	0.91
22	000001	平安银行	456,600	6,638,964.00	0.85
23	601390	中国中铁	455,400	6,234,426.00	0.80
24	601169	北京银行	422,100	5,622,372.00	0.72
25	601006	大秦铁路	396,100	5,561,244.00	0.71
26	000333	美的集团	140,400	5,234,112.00	0.67
27	600104	上汽集团	220,300	4,978,780.00	0.64
28	600048	保利地产	428,800	4,896,896.00	0.63
29	600900	长江电力	329,700	4,731,195.00	0.60
30	601336	新华保险	76,200	4,652,772.00	0.59
31	000166	申万宏源	283,600	4,608,500.00	0.59
32	002024	苏宁云商	295,100	4,515,030.00	0.58
33	600015	华夏银行	296,600	4,511,286.00	0.58
34	000776	广发证券	197,100	4,464,315.00	0.57
35	600795	国电电力	626,700	4,368,099.00	0.56
36	601688	华泰证券	186,500	4,313,745.00	0.55
37	600050	中国联通	564,800	4,139,984.00	0.53
38	600999	招商证券	154,700	4,093,362.00	0.52
39	000858	五粮液	126,400	4,006,880.00	0.51
40	600011	华能国际	279,800	3,925,594.00	0.50
41	000768	中航飞机	88,400	3,852,472.00	0.49
42	600649	城投控股	270,600	3,785,694.00	0.48
43	600383	金地集团	299,200	3,784,880.00	0.48
44	600570	恒生电子	32,900	3,686,445.00	0.47
45	601857	中国石油	323,600	3,666,388.00	0.47
46	600518	康美药业	205,000	3,634,650.00	0.46
47	002415	海康威视	80,200	3,592,960.00	0.46
48	000725	京东方A	678,500	3,521,415.00	0.45
49	002081	金螳螂	124,900	3,520,931.00	0.45
50	600637	百视通	82,133	3,456,156.64	0.44
51	600029	南方航空	233,900	3,400,906.00	0.43
52	600010	包钢股份	650,700	3,377,133.00	0.43
53	600886	国投电力	226,000	3,360,620.00	0.43

54	601377	兴业证券	242,400	3,318,456.00	0.42
55	601901	方正证券	274,200	3,260,238.00	0.42
56	000100	TCL 集团	569,000	3,214,850.00	0.41
57	601186	中国铁建	205,000	3,204,150.00	0.41
58	000625	长安汽车	150,300	3,178,845.00	0.41
59	300017	网宿科技	68,400	3,175,128.00	0.41
60	000069	华侨城A	242,200	3,143,756.00	0.40
61	000063	中兴通讯	130,900	3,116,729.00	0.40
62	000783	长江证券	221,100	3,084,345.00	0.39
63	600690	青岛海尔	101,400	3,075,462.00	0.39
64	600028	中国石化	425,600	3,004,736.00	0.38
65	000538	云南白药	34,600	2,984,942.00	0.38
66	600109	国金证券	120,800	2,947,520.00	0.38
67	600276	恒瑞医药	65,000	2,895,100.00	0.37
68	600019	宝钢股份	329,200	2,877,208.00	0.37
69	600585	海螺水泥	133,200	2,857,140.00	0.37
70	600415	小商品城	181,300	2,770,264.00	0.35
71	601088	中国神华	131,800	2,748,030.00	0.35
72	300024	机器人	34,900	2,696,374.00	0.34
73	601899	紫金矿业	526,400	2,695,168.00	0.34
74	600111	北方稀土	145,200	2,633,928.00	0.34
75	601009	南京银行	113,300	2,583,240.00	0.33
76	000630	铜陵有色	304,200	2,567,448.00	0.33
77	600089	特变电工	172,600	2,556,206.00	0.33
78	600221	海南航空	393,400	2,513,826.00	0.32
79	600100	同方股份	118,400	2,485,216.00	0.32
80	000728	国元证券	65,400	2,483,892.00	0.32
81	600839	四川长虹	246,000	2,420,640.00	0.31
82	600271	航天信息	36,900	2,387,799.00	0.31
83	300059	东方财富	37,800	2,384,802.00	0.30
84	601600	中国铝业	255,300	2,381,949.00	0.30
85	600703	三安光电	76,100	2,381,930.00	0.30
86	000157	中联重科	292,600	2,372,986.00	0.30
87	600150	中国船舶	45,900	2,363,850.00	0.30

88	000503	海虹控股	47,900	2,347,100.00	0.30
89	601618	中国中冶	324,500	2,346,135.00	0.30
90	002450	康得新	75,500	2,310,300.00	0.30
91	600705	中航资本	99,400	2,301,110.00	0.29
92	601018	宁波港	255,800	2,261,272.00	0.29
93	000402	金融街	159,300	2,250,909.00	0.29
94	600118	中国卫星	39,300	2,238,528.00	0.29
95	000338	潍柴动力	70,500	2,232,030.00	0.29
96	600804	鹏博士	74,100	2,212,626.00	0.28
97	600196	复星医药	76,200	2,205,228.00	0.28
98	300027	华谊兄弟	57,700	2,200,678.00	0.28
99	601669	中国电建	191,800	2,175,012.00	0.28
100	600352	浙江龙盛	151,600	2,148,172.00	0.27
101	600340	华夏幸福	70,500	2,146,725.00	0.27
102	600588	用友网络	46,500	2,133,420.00	0.27
103	600115	东方航空	169,500	2,088,240.00	0.27
104	002304	洋河股份	30,100	2,087,736.00	0.27
105	600256	广汇能源	199,400	2,073,760.00	0.26
106	600893	中航动力	38,900	2,067,535.00	0.26
107	600535	天士力	41,200	2,050,112.00	0.26
108	600009	上海机场	64,100	2,031,970.00	0.26
109	002292	奥飞动漫	53,600	2,028,760.00	0.26
110	601866	中海集运	211,300	2,007,350.00	0.26
111	600406	国电南瑞	97,000	2,006,930.00	0.26
112	600739	辽宁成大	81,500	1,992,675.00	0.25
113	002202	金风科技	102,300	1,991,781.00	0.25
114	600153	建发股份	113,300	1,983,883.00	0.25
115	000709	河北钢铁	282,900	1,980,300.00	0.25
116	600031	三一重工	202,900	1,966,101.00	0.25
117	600583	海油工程	117,800	1,962,548.00	0.25
118	601727	上海电气	131,200	1,958,816.00	0.25
119	002230	科大讯飞	56,000	1,956,640.00	0.25
120	000917	电广传媒	45,100	1,934,339.00	0.25
121	600177	雅戈尔	103,800	1,895,388.00	0.24

122	000423	东阿阿胶	34,728	1,892,676.00	0.24
123	000778	新兴铸管	145,600	1,886,976.00	0.24
124	601333	广深铁路	225,900	1,856,898.00	0.24
125	000039	中集集团	57,400	1,854,020.00	0.24
126	000061	农产品	90,400	1,844,160.00	0.24
127	601555	东吴证券	89,900	1,840,253.00	0.24
128	600674	川投能源	146,600	1,833,966.00	0.23
129	002241	歌尔声学	50,800	1,823,720.00	0.23
130	600066	宇通客车	88,450	1,817,647.50	0.23
131	600068	葛洲坝	153,300	1,792,077.00	0.23
132	601111	中国国航	113,500	1,743,360.00	0.22
133	600309	万华化学	72,000	1,740,960.00	0.22
134	300070	碧水源	35,600	1,736,924.00	0.22
135	601888	中国国旅	26,000	1,723,800.00	0.22
136	600023	浙能电力	173,500	1,721,120.00	0.22
137	002594	比亚迪	31,100	1,717,653.00	0.22
138	002465	海格通信	53,100	1,709,289.00	0.22
139	000559	万向钱潮	76,400	1,670,104.00	0.21
140	601800	中国交建	93,900	1,648,884.00	0.21
141	000060	中金岭南	88,400	1,643,356.00	0.21
142	601998	中信银行	212,500	1,638,375.00	0.21
143	000623	吉林敖东	47,600	1,599,360.00	0.20
144	002673	西部证券	55,800	1,583,046.00	0.20
145	600863	内蒙华电	193,400	1,582,012.00	0.20
146	600027	华电国际	141,700	1,575,704.00	0.20
147	601933	永辉超市	135,400	1,569,286.00	0.20
148	600085	同仁堂	43,600	1,565,676.00	0.20
149	600688	上海石化	145,900	1,565,507.00	0.20
150	000793	华闻传媒	75,400	1,564,550.00	0.20
151	600315	上海家化	35,800	1,553,720.00	0.20
152	002008	大族激光	53,700	1,542,264.00	0.20
153	600157	永泰能源	223,620	1,538,505.60	0.20
154	300104	乐视网	29,700	1,537,272.00	0.20
155	000629	攀钢钒钛	286,100	1,533,496.00	0.20

156	000568	泸州老窖	46,700	1,522,887.00	0.19
157	000686	东北证券	78,200	1,522,554.00	0.19
158	600642	申能股份	151,600	1,517,516.00	0.19
159	601099	太平洋	116,300	1,502,596.00	0.19
160	300124	汇川技术	31,100	1,492,800.00	0.19
161	600369	西南证券	75,200	1,477,680.00	0.19
162	000839	中信国安	62,600	1,475,482.00	0.19
163	600741	华域汽车	68,800	1,468,880.00	0.19
164	002065	东华软件	50,300	1,446,125.00	0.18
165	601607	上海医药	64,000	1,425,280.00	0.18
166	600252	中恒集团	61,700	1,419,100.00	0.18
167	000895	双汇发展	65,850	1,404,580.50	0.18
168	601179	中国西电	136,500	1,399,125.00	0.18
169	601898	中煤能源	121,900	1,392,098.00	0.18
170	601168	西部矿业	127,000	1,386,840.00	0.18
171	000009	中国宝安	84,800	1,383,088.00	0.18
172	002142	宁波银行	64,900	1,372,635.00	0.18
173	600875	东方电气	66,500	1,361,255.00	0.17
174	002353	杰瑞股份	30,500	1,352,675.00	0.17
175	000800	一汽轿车	54,200	1,348,496.00	0.17
176	600663	陆家嘴	27,100	1,347,954.00	0.17
177	600660	福耀玻璃	93,400	1,333,752.00	0.17
178	002456	欧菲光	39,300	1,325,982.00	0.17
179	600018	上港集团	166,700	1,318,597.00	0.17
180	300003	乐普医疗	32,400	1,314,468.00	0.17
181	000826	桑德环境	33,700	1,310,593.00	0.17
182	600060	海信电器	52,300	1,286,057.00	0.16
183	601117	中国化学	131,400	1,285,092.00	0.16
184	600489	中金黄金	98,000	1,261,260.00	0.16
185	000425	徐工机械	94,300	1,251,361.00	0.16
186	600718	东软集团	57,200	1,242,956.00	0.16
187	000883	湖北能源	142,500	1,242,600.00	0.16
188	002236	大华股份	38,900	1,241,688.00	0.16
189	600208	新潮中宝	160,500	1,239,060.00	0.16

190	600332	白云山	35,600	1,226,776.00	0.16
191	600372	中航电子	35,100	1,226,043.00	0.16
192	000581	威孚高科	39,500	1,224,105.00	0.16
193	300058	蓝色光标	76,939	1,216,405.59	0.16
194	002500	山西证券	67,100	1,213,839.00	0.16
195	002129	中环股份	61,100	1,209,169.00	0.15
196	000792	盐湖股份	42,300	1,200,474.00	0.15
197	600362	江西铜业	55,300	1,189,503.00	0.15
198	601788	光大证券	44,100	1,188,495.00	0.15
199	002252	上海莱士	18,100	1,184,464.00	0.15
200	600547	山东黄金	47,400	1,170,780.00	0.15
201	000970	中科三环	56,700	1,168,587.00	0.15
202	601106	中国一重	96,100	1,163,771.00	0.15
203	600867	通化东宝	52,710	1,155,930.30	0.15
204	000598	兴蓉环境	119,300	1,141,701.00	0.15
205	601633	长城汽车	26,700	1,141,692.00	0.15
206	600170	上海建工	118,700	1,113,406.00	0.14
207	000878	云南铜业	45,000	1,102,500.00	0.14
208	601808	中海油服	39,400	1,100,836.00	0.14
209	000413	东旭光电	112,400	1,099,272.00	0.14
210	601098	中南传媒	47,800	1,095,098.00	0.14
211	002385	大北农	80,050	1,082,276.00	0.14
212	600873	梅花生物	103,500	1,080,540.00	0.14
213	000960	锡业股份	53,600	1,080,040.00	0.14
214	000825	太钢不锈	151,700	1,078,587.00	0.14
215	600600	青岛啤酒	23,100	1,076,229.00	0.14
216	600108	亚盛集团	103,700	1,074,332.00	0.14
217	600827	百联股份	51,300	1,067,553.00	0.14
218	002153	石基信息	8,200	1,065,918.00	0.14
219	002375	亚厦股份	35,600	1,039,876.00	0.13
220	000750	国海证券	61,500	1,033,200.00	0.13
221	002736	国信证券	41,100	1,031,199.00	0.13
222	002038	双鹭药业	18,200	1,031,030.00	0.13
223	000963	华东医药	14,400	1,029,312.00	0.13

224	000400	许继电气	40,300	1,013,948.00	0.13
225	000738	中航动控	30,500	1,011,380.00	0.13
226	600958	东方证券	35,100	1,004,562.00	0.13
227	000831	五矿稀土	39,200	1,002,736.00	0.13
228	000983	西山煤电	104,900	994,452.00	0.13
229	600316	洪都航空	28,600	988,988.00	0.13
230	601216	内蒙君正	40,900	984,463.00	0.13
231	002310	东方园林	25,600	980,480.00	0.13
232	600166	福田汽车	111,000	980,130.00	0.13
233	000027	深圳能源	79,200	978,120.00	0.12
234	000729	燕京啤酒	93,500	972,400.00	0.12
235	600497	驰宏锌锗	66,600	971,694.00	0.12
236	300251	光线传媒	39,000	971,100.00	0.12
237	603000	人民网	18,400	959,192.00	0.12
238	002422	科伦药业	23,900	956,956.00	0.12
239	002146	荣盛发展	75,800	947,500.00	0.12
240	601919	中国远洋	75,800	945,984.00	0.12
241	601258	庞大集团	172,600	942,396.00	0.12
242	600005	武钢股份	133,300	937,099.00	0.12
243	600597	光明乳业	40,700	936,100.00	0.12
244	600008	首创股份	64,200	921,270.00	0.12
245	002470	金正大	41,600	903,136.00	0.12
246	000898	鞍钢股份	122,800	896,440.00	0.11
247	601929	吉视传媒	58,600	886,032.00	0.11
248	002410	广联达	37,500	877,500.00	0.11
249	601928	凤凰传媒	50,800	868,680.00	0.11
250	601992	金隅股份	72,200	862,790.00	0.11
251	002007	华兰生物	19,300	854,797.00	0.11
252	002475	立讯精密	24,900	841,869.00	0.11
253	600373	中文传媒	35,000	838,600.00	0.11
254	300015	爱尔眼科	25,947	837,050.22	0.11
255	600578	京能电力	92,200	823,346.00	0.11
256	600348	阳泉煤业	80,100	821,025.00	0.10
257	600516	方大炭素	68,700	818,217.00	0.10

258	000876	新希望	41,600	807,456.00	0.10
259	002570	贝因美	40,800	791,928.00	0.10
260	000999	华润三九	26,000	790,140.00	0.10
261	600277	亿利能源	53,200	777,784.00	0.10
262	600633	浙报传媒	39,500	774,200.00	0.10
263	601699	潞安环能	79,690	770,602.30	0.10
264	601118	海南橡胶	78,500	767,730.00	0.10
265	300146	汤臣倍健	19,400	762,032.00	0.10
266	601958	金钼股份	64,400	758,632.00	0.10
267	002344	海宁皮城	37,300	732,199.00	0.09
268	600549	厦门钨业	28,730	725,719.80	0.09
269	600038	中直股份	11,700	724,815.00	0.09
270	300133	华策影视	25,600	691,200.00	0.09
271	002416	爱施德	33,400	690,378.00	0.09
272	000712	锦龙股份	19,200	673,920.00	0.09
273	000046	泛海控股	44,900	657,785.00	0.08
274	600398	海澜之家	35,900	650,867.00	0.08
275	600648	外高桥	17,800	624,424.00	0.08
276	002001	新和成	36,200	618,658.00	0.08
277	002051	中工国际	20,600	613,468.00	0.08
278	002294	信立泰	20,900	597,740.00	0.08
279	603288	海天味业	17,900	571,726.00	0.07
280	000937	冀中能源	70,590	566,131.80	0.07
281	600783	鲁信创投	14,800	554,704.00	0.07
282	601991	大唐发电	68,800	549,024.00	0.07
283	002399	海普瑞	15,900	540,441.00	0.07
284	600395	盘江股份	31,600	496,436.00	0.06
285	600809	山西汾酒	17,300	488,552.00	0.06
286	600998	九州通	21,800	487,448.00	0.06
287	601021	春秋航空	3,800	479,142.00	0.06
288	300002	神州泰岳	31,400	478,536.00	0.06
289	600485	信威集团	9,700	425,733.00	0.05
290	601158	重庆水务	38,300	411,342.00	0.05
291	600717	天津港	27,100	406,229.00	0.05

292	600317	营口港	63,100	397,530.00	0.05
293	002653	海思科	14,300	386,100.00	0.05
294	600188	兖州煤业	25,600	352,000.00	0.04
295	601225	陕西煤业	33,300	272,394.00	0.03
296	601231	环旭电子	14,400	244,944.00	0.03
297	603993	洛阳钼业	17,500	216,300.00	0.03
298	000156	华数传媒	4,700	168,166.00	0.02
299	601969	海南矿业	6,000	109,380.00	0.01

#### 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	13,789,571.00	0.73
2	601318	中国平安	7,530,813.00	0.40
3	000166	申万宏源	5,983,536.95	0.32
4	300059	东方财富	3,179,380.00	0.17
5	601857	中国石油	2,241,710.00	0.12
6	600637	百视通	2,222,025.00	0.12
7	300104	乐视网	2,060,134.00	0.11
8	600585	海螺水泥	1,890,118.00	0.10
9	000413	东旭光电	1,872,290.00	0.10
10	601099	太平洋	1,864,537.00	0.10
11	601398	工商银行	1,790,262.00	0.10
12	601106	中国一重	1,767,338.00	0.09
13	600023	浙能电力	1,751,314.00	0.09
14	300003	乐普医疗	1,700,590.00	0.09
15	601788	光大证券	1,532,915.00	0.08
16	600109	国金证券	1,504,932.00	0.08
17	601939	建设银行	1,347,711.00	0.07
18	600958	东方证券	1,320,282.00	0.07
19	002736	国信证券	1,290,276.00	0.07
20	600875	东方电气	1,229,911.00	0.07

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费

用。

#### 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

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	67,687,161.01	3.60
2	600036	招商银行	42,910,149.77	2.28
3	600016	民生银行	41,765,632.49	2.22
4	600030	中信证券	38,142,170.96	2.03
5	600837	海通证券	32,298,318.64	1.72
6	601766	中国中车	31,479,644.81	1.67
7	601166	兴业银行	30,974,318.36	1.65
8	600000	浦发银行	28,251,158.12	1.50
9	601398	工商银行	21,589,735.00	1.15
10	601668	中国建筑	21,300,034.00	1.13
11	000002	万科A	20,124,494.80	1.07
12	601390	中国中铁	19,059,187.00	1.01
13	000651	格力电器	18,892,580.62	1.00
14	601601	中国太保	18,803,549.52	1.00
15	601939	建设银行	16,705,017.04	0.89
16	600519	贵州茅台	16,608,478.44	0.88
17	600887	伊利股份	16,214,924.82	0.86
18	000001	平安银行	15,717,414.22	0.84
19	601328	交通银行	15,646,360.00	0.83
20	601989	中国重工	15,522,037.42	0.82

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	140,102,040.96
卖出股票的收入（成交）总额	1,702,802,007.13

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除中信证券和海通证券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。

中信证券于2015年1月19日公告称，因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

海通证券于2015年1月20日公告称，公司因存在违规为到期融资融券合约展期问题，受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

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信证券和海通证券的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对相关投资判断未发生改变。

##### 7.12.2 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。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	569,286.29
2	应收证券清算款	1,162,865.45
3	应收股利	—

4	应收利息	9,515.75
5	应收申购款	110,195.75
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	1,851,863.24

#### 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不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份额 比例	持有 份额	占总份额 比例
716	569,036.51	400,040,833.33	98.19%	7,389,305.54	1.81%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	108,039.33	0.03%

### 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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研  
究部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本  
基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年6月5日)基金份额总额	5,130,087,968.40
本报告期期初基金份额总额	1,237,491,250.57
本报告期基金总申购份额	33,341,110.74
减：本报告期基金总赎回份额	863,402,222.44
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	407,430,138.87

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开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

(1) 本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

(2) 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	405,166,153.54	22.85%	287,828.45	23.63%	

申万宏源	2	392,538,395.69	22.13%	278,858.49	22.89%	
海通证券	2	130,924,124.13	7.38%	119,193.70	9.79%	
招商证券	2	319,821,102.04	18.03%	227,201.87	18.65%	
中金公司	2	177,097,702.89	9.99%	72,681.31	5.97%	
兴业证券	2	199,608,952.49	11.26%	141,802.53	11.64%	
国信证券	2	148,262,865.41	8.36%	90,499.79	7.43%	

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳腾元基金销售有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-06-30
2	国寿安保基金管理有限公司办公地址变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-06-08
3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-06-06
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-06-01

	网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	网站	
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-05-28
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-05-26
7	国寿安保基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职情况变更的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-05-25
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-05-22
9	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金在江苏张家港农村商业银行股份有限公司开通定期定额申购业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-05-20
10	国寿安保沪深300指数型证券投资基金2015年第1季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-04-20
11	国寿安保沪深300指数型证券投资基金2014年年度报告摘要	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-03-30
12	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保沪深300指数型证券投资基金新增基金经理的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-03-23
13	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金在中国农业银行开通定期定额申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-02-16
14	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-01-27
15	国寿安保沪深300指数型证券投资基金2014年第4季度报告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》及公司网站	2015-01-21
16	国寿安保沪深300指数型证券投资基	《中国证券报》、《证券时	2015-01-16

	金更新招募说明书摘要（2015年第1号）	报》、《上海证券报》及公司网站	
--	----------------------	-----------------	--

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 11.1.1 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
- 11.1.2 《国寿安保沪深300指数型证券投资基金基金合同》
- 11.1.3 《国寿安保沪深300指数型证券投资基金托管协议》
- 11.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 11.1.5 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
- 11.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 11.2 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

### 11.3 查阅方式

- 11.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 11.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)
- 11.3.3 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  
二〇一五年八月二十八日