# 安信目标收益债券型证券投资基金

## 2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
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01月21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2015年1月19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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 安信目标收益债券 | |
| 基金主代码 | 750002 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年09月25日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 260,110,247.85份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下,以3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)为收益跟踪目标,并力争实现超越目标基准的投资回报。 | |
| 投资策略 | 基于货币政策研究、利率研究等宏观基本面研究,根据风险收益特征对普通债券、浮动利息债券、可转换债券和资产支持证券等大类资产进行配置比例。通过研究基准利率类型、利差水平、发行主体等因素,并结合市场预期分析和对市场基准利率走势的判断,制定浮息债的投资策略。密切跟踪债券发行市场的供应状况,深入研究利差变动,在重点研究发行人特征及其信用水平、债券类型、担保情况、发行利率和承销商构成的基础上积极参与债券一级市场投资。可转债的投资采取基本面分析和量化分析相结合的方法,利用期权定价模型等数量化方法对可转债的价值进行估算,选择价值低估的可转换债券进行投资。同时,持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展,对普通的和创新性的资产支持证券品种进行深入分析,制定周密资产支持证券投资策略。普通债券投资策略包括品种配置策略、收益率曲线配置策略、利率策略、信用策略、债券选择策略、回购策略等。 | |
| 业绩比较基准 | 3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M)。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,但高于货币市场基金,属于中低风险和收益水平的投资品种。 | |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 安信目标收益债券A | 安信目标收益债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 750002 | 750003 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 46,815,293.52份 | 213,294,954.33份 |

§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10月01日-2014年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 安信目标收益债券A | 安信目标收益债券C |
| 1.本期已实现收益 | 1,320,319.78 | 5,367,729.73 |
| 2.本期利润 | 2,182,163.18 | 5,873,815.81 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0410 | 0.0277 |
| 4.期末基金资产净值 | 50,307,169.41 | 226,961,184.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.075 | 1.064 |

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2、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。

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

安信目标收益债券A

| 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 | 2.97% | 0.22% | 1.05% | 0.01% | 1.92% | 0.21% |

安信目标收益债券C

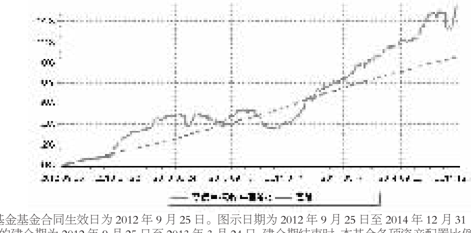
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 2.80% | 0.23% | 1.05% | 0.01% | 1.75% | 0.22% |

注:业绩比较基准=3个月期上海银行间同业拆放利率(Shibor 3M),业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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:1、本基金基金合同生效日为2012年9月25日。图示日期为2012年9月25日至2014年12月31日。

2、本基金的建仓期为2012年9月25日至2013年3月24日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。



注:1、本基金基金合同生效日为2012年9月25日。图示日期为2012年9月25日至2014年12月31日。

2、本基金的建仓期为2012年9月25日至2013年3月24日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

§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 | | |
| 李勇 | 本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理 | 2012年09月25日 | | 8 | 李勇先生,经济学硕士。历任中国农业银行股份有限公司总行金融市场部交易员、高级投资经理。现任安信基金管理有限责任公司固定收益投资总监兼固定收益部总经理。曾任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理;现任安信目标收益债券型证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金的基金经理。 |

注:1、此处的任职日期为本基金合同生效日。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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

本报告期内,本基金管理人严格执行《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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度债券市场呈现了一个先涨后跌的行情。10月整体是显著的牛市,11月中旬见顶以后,出现了一轮比较显著的调整,12月下旬开始,又出现了比较明显的回暖。

四季度的震荡,主要原因:

一是期间股票牛市吸引了大量的存量资金;证券市场的交易结算资金从4季度初的7900多亿,上涨到12月底的1.1万亿,期间最高超过1.3万亿。就是说有3000-5000亿的增量资金涌入股市。大多数债券基金、货币基金都出现了规模的萎缩,形成被动性卖盘。

二是期间IPO吸引了空前大的资金量,造成了阶段性的资金极端紧张局面。一个月同存峰值最高到过8-9%,银行间隔夜回购也冲高到近年来较少见的3.5%。

三是股票牛市和交易火爆引发了监管层对货币空转的担忧,可能由于担心积极的货币政策释放的增量流动性无法疏导到实体经济,而是堆积在证券市场,导致货币政策有一定转紧的迹象。进一步降准降息的预期短期落空。

四季度前期,我们坚持了短久期、低杠杆的保守策略。在中证登大规模暂停交易所债券新增质押的事件发生后,我们抓住机会,增加了债券仓位配置。牛市格局较为明确后,我们适当参与了转债,为投资者增进了收益,净值再创新高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金A类份额净值为1.075元,本基金C类份额净值为1.064元。本报告期本基金A类份额净值增长率为2.97%,本基金C类份额净值增长率为2.80%,同期业绩比较基准增长为1.05%。基金业绩分别高于同期业绩比较基准1.92%和1.75%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续20个工作日基金份额持有人不满200人或基金资产净值低于5000万元人民币的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2015年的债市的主要特征是震荡为主,震荡中略显涨势,我们持谨慎乐观的态度。

略显涨势的逻辑如下:

1、预期2015年的宏观经济仍将维持弱势。房地产预期将出现一定回暖,但面对略有起色的经济形势,货币政策不太可能转向紧缩。认为经济面和政策面对于债市来说,没有大的风险。所以债券趋势性的熊市发生概率不大。

2、大宗商品和油价低位的大背景下,CPI、PPI估计仍将低位运行,甚至有一定的通缩风险。实施中性偏积极的货币政策没有通胀方面的障碍。

3、认为注册制的推行,将对中小盘股的壳资源价值形成重大打击,进而侵蚀整体的牛市进程。股市资金可能会出现一定的分流,目前债市资金的净流出现象大概率将得到一定的改善。

震荡的逻辑如下:

1、考虑到引导资金流向实体经济的监管目的,预期2015年的IPO扩容将成为大概率事件。所以资金面的波动幅度,可能继续加大。

2、两融的继续发展以及股票期权的推行,以及股票的各种创新,可能导致股市的波动增加,股市波动性的增加,可能导致资金流向的无常,这也会间接地的影响债市资金。

3、债市信用风险事件可能增加,这个除了将影响债券的信用利差以外,也可能影响到机构的配置信心,导致他们在特定条件下主动的去杠杆。另外,交易所债券信用事件,可能使交易所继续主动降低交易所债券质押比例,引起阶段性的被动去杠杆。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 451,122,014.56 | 95.39 |
| | 其中:债券 | 451,122,014.56 | 95.39 |
| | 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 | 5,929,810.13 | 1.25 |
| 8 | 其他资产 | 15,894,018.85 | 3.36 |
| 9 | 合计 | 472,945,843.54 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 280,800.00 | 0.10 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 19,988,000.00 | 7.21 |
| | 其中:政策性金融债 | 114,374,458.70 | 41.25 |
| 4 | 企业债券 | 147,104,137.90 | 53.05 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 100,163,000.00 | 36.12 |
| 7 | 可转债 | 39,199,617.96 | 14.14 |
| 8 | 其他 | 144,386,458.70 | 52.07 |
| 9 | 合计 | 451,122,014.56 | 162.70 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 018001 | 国开1301 | 740,480 | 76,069,510.40 | 27.44 |
| 2 | 123324 | 14民族01 | 500,000 | 50,000,000.00 | 18.03 |
| 3 | 101352005 | 13铁物质MTN002 | 500,000 | 49,480,000.00 | 17.85 |
| 4 | 122266 | 13中信03 | 408,210 | 40,976,119.80 | 14.78 |
| 5 | 1182094 | 11苏海企MTN1 | 300,000 | 30,213,000.00 | 10.90 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为债券型基金,不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的备选证券库,本基金管理人从制度和流程上要求证券必须先入库再买入。

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 | 57,076.06 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,742,125.12 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 13,094,817.67 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,894,018.85 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 安信目标收益债券A | 安信目标收益债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 70,940,572.09 | 180,041,004.78 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 37,407,495.83 | 53,962,232.92 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 61,532,774.40 | 20,708,283.37 |
| 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 | 46,815,293.52 | 213,294,954.33 |

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,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

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金基金管理人2014年11月20日发布公告,从2014年11月19日起聘任李学明为公司副总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信目标收益债券型证券投资基金募集的文件;

2、《安信目标收益债券型证券投资基金基金合同》;

3、《安信目标收益债券型证券投资基金托管协议》;

4、《安信目标收益债券型证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话:4008-088-088

网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司

二〇一五年一月二十一日

# 安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2014 第四季度 报告

2014年12月31日

基金管理人:安信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年1月21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2015年1月19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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 安信灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 750001 |
| 交易代码 | 750001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年6月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 35,993,664.02份 |
| 投资目标 | 灵活运用多种投资策略,深入挖掘和把握市场投资机会,分享中国经济增长和资本市场发展的成果,力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报 |
| 投资策略 | 本基金采取"自上而下"和"自下而上"相结合的模式,在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上,以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本,结合金融市场行为分析,根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断,动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略,实现基金资产长期稳定增值 |
| 业绩比较基准 | 60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高风险和预期风险水平的投资品种 |
| 基金管理人 | 安信基金管理有限责任公司 |
| 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(2014年10月1日-2014年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 8,097,679.71 |
| 2.本期利润 | 12,400,719.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2915 |
| 4.期末基金资产净值 | 50,862,229.33 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.413 |

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2、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。

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 | 26.99% | 1.21% | 26.03% | 0.99% | 0.96% | 0.22% |

注:业绩比较基准收益率=沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%,业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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:1、本基金基金合同生效日为2012年6月20日。图示日期为2012年6月20日至2014年12月31日。

2、本基金的建仓期为2012年6月20日至2012年12月19日,建仓期结束时,本基金各项资产配置比例均符合本基金合同的约定。

§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 | | |
| 黄立华 | 本基金的基金经理 | 2014年1月15日 | - | 8 | 黄立华先生,理学硕士、工商管理硕士,注册金融分析师(CFA)。历任Lanae Technology(美国)项目经理。Emory Investment Management(美国)公司研究员,Eamest Partners(美国)公司研究员、投资经理,安信证券股份有限公司高级投资经理。2013年2月加入安信基金管理有限责任公司基金投资部。曾任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理;现任安信平稳增长混合型发起式证券投资基金的基金经理助理,安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

注:1、此处任职日期是指其注册成为本基金的基金经理注册生效日。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有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

本报告期内,本基金管理人严格执行《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,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度,在经济改革持续推进、降息及其他货币宽松政策的推进,资金成本下降,IPO继续限量发行,增量资金加快进入股市等因素的刺激下,A股大盘迎来了持续时间较长的反弹。本基金在进入四季度以后,出于对于整体创业板估值泡沫积累的担忧,逐渐降低了高估值品种的配置比例,适度保留了一些成长性长期看好的并受益于经济结构转型的品种,同时逐步增加了大盘蓝筹股的配置比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.413元,本报告期份额净值增长率为26.99%,同期业绩比较基准增长率为26.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金出现了连续20个工作日基金资产净值低于5000万元人民币的情形,时间范围为2014年11月28日至2014年12月26日。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年一季度,海外发达国家经济复苏虽然比预期要弱,但发达国家尤其是美国经济内在的复苏还是很明显。前期公布的地产和工业增加值等数据普遍反映国内经济偏弱,出于稳定经济增长的需要,在前三季度推出一系列措施如加快基建项目批复和高铁建设、定向降准、放松银行的存贷比等的基础上,政府进入四季度开始在地产政策出现明显的放松。在宏观经济能够相对稳定和资金成本逐步下降的背景下,虽然大盘从底部反弹了约50%,但蓝筹股从估值和业绩角度出发依然有吸引力,在资金面持续宽松背景下,蓝筹股下行空间有限,而创业板估值经过四季度末期的较大回调后,虽然整体依然有泡沫,但预计后面小股票会出现分化,一些业绩可持续的成长股在2015年有望出现较好的投资机会。在深港通推出的预期下,A股的一些稀缺品种和防御性板块如消费医药等有可能受投资者关注。安信策略精选灵活配置基金在做好大类资产配置同时,以精选个股为主,重点关注低估值而盈利前景看好的蓝筹股以及受益于经济结构转型的行业及其优质成长股,如非银金融、房地产、传统制造业、TMT、消费医药、高端装备、新能源等,同时关注市场化改革相关受益领域和新股的投资机会。

§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 | 38,979,540.00 | 74.81 |
| | 其中:股票 | 38,979,540.00 | 74.81 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,678,120.00 | 7.06 |
| | 其中:债券 | 3,678,120.00 | 7.06 |
| | 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 | 6,000,000.00 | 11.52 |
| | 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 | 2,933,146.23 | 5.63 |
| 8 | 其他资产 | 513,767.91 | 0.99 |
| 9 | 合计 | 52,104,574.14 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 31,860.00 | 0.06 |
| C | 制造业 | 22,650,640.00 | 44.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 590,000.00 | 1.16 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 324,400.00 | 0.64 |
| J | 金融业 | 6,689,600.00 | 13.15 |
| K | 房地产业 | 5,005,600.00 | 9.84 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,283,700.00 | 2.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 820,500.00 | 1.61 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 604,400.00 | 1.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 978,840.00 | 1.92 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 38,979,540.00 | 76.64 |

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 | 600030 | 中信证券 | 100,000 | 3,390,000.00 | 6.67 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 110,000 | 3,149,300.00 | 6.19 |
| 3 | 000002 | 万 科A | 220,000 | 3,058,000.00 | 6.01 |
| 4 | 000625 | 长安汽车 | 180,000 | 2,957,400.00 | 5.81 |
| 5 | 300011 | 鼎汉技术 | 120,000 | 2,430,000.00 | 4.78 |
| 6 | 600999 | 招商证券 | 80,000 | 2,261,600.00 | 4.45 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 180,000 | 1,947,600.00 | 3.83 |
| 8 | 000858 | 五 粮 液 | 90,000 | 1,935,000.00 | 3.80 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 10,000 | 1,896,200.00 | 3.73 |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 80,000 | 1,766,400.00 | 3.47 |

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 3,678,120.00 | 7.23 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 3,678,120.00 | 7.23 |

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 | 110015 | 石化转债 | 20,000 | 2,698,400.00 | 5.31 |
| 2 | 110029 | 浙能转债 | 7,000 | 979,720.00 | 1.93 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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未有被监管部门立案调查,不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库,本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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 | 48,977.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | 424,399.67 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 19,613.12 |
| 5 | 应收申购款 | 20,777.80 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 513,767.91 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 2,698,400.00 | 5.31 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300011 | 鼎汉技术 | 2,430,000.00 | 4.78 | 重大事项停牌 |

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 28,143,297.85 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 86,456,644.67 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 78,606,278.50 |
| 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 | 35,993,664.02 |

注:总申购份额含红利再投和转换入份额,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

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金基金管理人2014年11月20日发布公告,从2014年11月19日起聘任李学明为公司副总经理。

2、本基金基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;

5、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

安信基金管理有限责任公司

地址:中国广东省深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心36层

9.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅,或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话:4008-088-088

网址:http://www.essencefund.com

安信基金管理有限责任公司

二〇一五年一月二十一日

# 国寿安保沪深300指数型证券投资基金

## 2014 第四季度 报告

2014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:2015年1月21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2015年1月20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 |
| 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 | 1,237,491,250.57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10月1日-2014年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 72,045,769.46 |
| 2.本期利润 | 449,975,824.93 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.4168 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,881,917,421.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.5208 |

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。

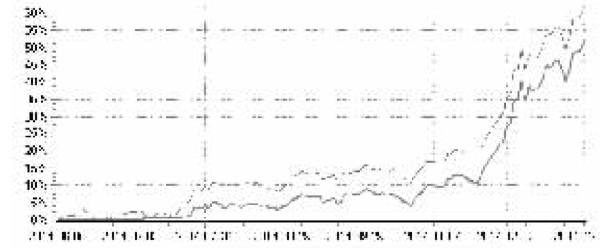
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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 | 41.27% | 1.55% | 41.63% | 1.56% | -0.36% | -0.01% |

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。

§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4季度,宏观经济增速进一步放缓,通胀水平下降明显。政府继续实行积极财政政策,央行采取了降息措施。同时,各项改革措施进一步推进,沪港通正式开通,股票市场资金继续流入,沪深300指数上涨明显。

3季度本基金牢牢抓住市场机会,加快了建仓节奏,已经基本完成了建仓工作。4季度建仓期结束后,本基金严格按照基金合同进行被动操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日,本基金份额净值为1.5208元,累计份额净值为1.5208元。报告期内净值增长率为41.27%,同期业绩基准涨幅为41.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年1季度,宏观经济仍然处于转型过程中,各项改革将进一步推进,GDP增速仍然处于低位,通胀虽然短期有所抬升,但仍然处于较低水平。外部看,美联储加息、欧元区政治经济局势变化等外部事件可能对市场形成短暂冲击;内部看,在经历前期快速上涨之后,预计市场波动将进一步加大。本基金将严格遵守基金合同,力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

§5 投资组合报告

5.1 报告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 | 1,781,156,662.00 | 94.43 |
| | 其中:股票 | 1,781,156,662.00 | 94.43 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 50,070,000.00 | 2.65 |
| | 其中:债券 | 50,070,000.00 | 2.65 |
| | 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 | 52,258,765.70 | 2.77 |
| 8 | 其他资产 | 2,666,788.99 | 0.14 |
| 9 | 合计 | 1,886,152,216.69 | 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(指数投资)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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,280,384.00 | 0.28 |
| B | 采矿业 | 83,843,368.00 | 4.46 |
| C | 制造业 | 539,281,276.00 | 28.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 63,942,730.00 | 3.40 |
| E | 建筑业 | 83,018,210.00 | 4.41 |
| F | 批发和零售业 | 40,451,065.00 | 2.15 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 47,855,340.00 | 2.54 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 60,613,267.00 | 3.22 |
| J | 金融业 | 711,010,660.00 | 37.78 |
| K | 房地产业 | 82,230,350.00 | 4.37 |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,761,710.00 | 0.94 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 17,970,167.00 | 0.95 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,526,270.00 | 0.08 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 20,899,844.00 | 1.11 |
| S | 综合 | 5,472,021.00 | 0.29 |
| | 合计 | 1,781,156,662.00 | 94.65 |

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

5.3 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

5.3.1 期末指数投资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

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 | 1,064,500 | 79,528,795.00 | 4.23 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 5,764,500 | 62,717,760.00 | 3.33 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 3,509,600 | 58,224,264.00 | 3.09 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 1,673,800 | 56,741,820.00 | 3.02 |
| 5 | 600837 | 海通证券 | 1,720,900 | 41,404,854.00 | 2.20 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 2,431,000 | 40,111,500.00 | 2.13 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 2,380,100 | 37,343,769.00 | 1.98 |
| 8 | 000002 | 万 科A | 2,062,800 | 28,672,920.00 | 1.52 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 5,721,700 | 27,864,679.00 | 1.48 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 776,700 | 25,087,410.00 | 1.33 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,070,000.00 | 2.66 |
| | 其中:政策性金融债 | 50,070,000.00 | 2.66 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 50,070,000.00 | 2.66 |

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

金额单位:人民币元

| 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 | 140443 | 14农发43 | 500,000 | 50,070,000.00 | 2.66 |

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

5.10.1 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。

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 710,644.92 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 812,339.97 |
| 5 | 应收申购款 | 1,143,804.10 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,666,788.99 |

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 | 1,318,967,015.16 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 398,535,173.81 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 480,010,938.40 |
| 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 | 1,237,491,250.57 |

§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

二〇一五年一月二十一日