

国寿安保尊享债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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:中信银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)

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。

注:本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资者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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

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:本基金基金合同生效日期为2015年7月22日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满足一年,图示日期为2015年7月22日至2015年9月30日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限

注:任职日期为基金合同生效日,证券从业的年限遵从行业协会《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》、《国寿安保尊享债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

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 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

第三季度宏观经济企稳回升,央行货币政策维持宽松基调,银行间市场的流动性较为充裕,在人民币贬值造成流动性趋紧后央行及时对冲增加了资金面流动性,增加了市场投资者的信心。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

本基金投资于国内债券,截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.062元,累计份额净值为1.062元,报告期内净值增长率为2.01%,同期业绩比较基准收益率为1.78%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

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

中长期来看,房地产长期调控和地方政府财政纪律加强使得宏观经济逐步步入实质性的去杠杆阶段,在经济总体去杠杆的环境下,中央和地方政府积极财政政策性增强的主要切入人点,目前,主要的经济周期指标和中观行业

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司

重要提示
基金管理人及基金托管人不存在虚假记载、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。

Table with 2 columns: 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年7月01日至2015年9月30日)

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。

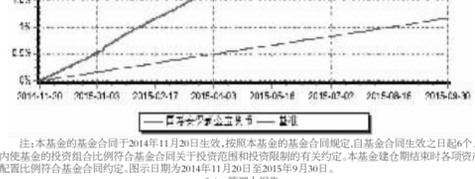
注:本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资者的实际收益水平要低于所列数字。

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准②, 业绩比较基准收益率③, ①-③, ②-④

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11月20日生效,按照本基金基金合同约定,自基金合同生效之日起至第6个月内资产配置比例符合基金合同约定,图示日期为2014年11月20日至2015年9月30日。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限

注:任职日期为基金合同生效日,证券从业的年限遵从行业协会《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》、《国寿安保尊享债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

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 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年3季度,货币市场受到多重因素影响呈现前低后高的走势,银行间市场隔夜回购利率从7月初的2.9%快速回落至11%左右,7天回购利率则基本稳定在2.5%附近。

3季度,本基金主要持仓短期国债和同业存款,管理现金流,保障组合充足流动性,整体看,3季度本基金仓位、流动性及风险控制良好,为下一阶段抓住市场机遇,创造主动收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金基金份额净值收益率为0.9031%,同期业绩比较基准收益率为0.3419%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

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年四季度,国内外宏观经济走势和政策将成为影响股市市场的主要因素,海外方面,美联储在年内可能加息,地缘政治中可能影响商品价格产生冲击,各种政策、经济数据影响市场情绪,国内方面,3季度稳增长政策持续发力,央行可能有效提高人民币利率,人民币可能加入SDR,这些都将影响股市市场走势。

综合当前国内外经济和货币环境,预计4季度仍将维持稳健货币政策的基调,并随着国内外经济状况进行动态调整;通过公开市场操作等政策工具引导市场利率。

针对上述复杂的市场环境,本基金将持续跟踪市场,强化投资组合流动性,以确保组合安全性和流动性为主要任务,兼顾收益性,密切关注各项宏观经济数据,政策调整和市场资金面情况,平衡组合流动性与债券投资,谨慎控制组合的信用风险,保持合理流动性资产比例,精细化管理风险,以控制利率风险和组合内资产波动,努力为客户创造主动稳定的收益。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:本基金投资组合中公允价值计量为15.2361亿元,公允价值计量资产占基金总资产的99.99%。

5.2 投资组合报告

5.2.1 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。

5.2.2 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.4 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。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

5.2.7 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。

5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同约定规定备选股票库之外的股票。

5.2.8.2 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同约定规定备选股票库之外的股票。

5.2.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

5.4 管理人对报告期内基金运作情况的说明

5.4.1 基金运作分析

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。

5.4.2 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

5.4.3 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 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年3季度,货币市场受到多重因素影响呈现前低后高的走势,银行间市场隔夜回购利率从7月初的2.9%快速回落至11%左右,7天回购利率则基本稳定在2.5%附近。

3季度,本基金主要持仓短期国债和同业存款,管理现金流,保障组合充足流动性,整体看,3季度本基金仓位、流动性及风险控制良好,为下一阶段抓住市场机遇,创造主动收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金基金份额净值收益率为0.9031%,同期业绩比较基准收益率为0.3419%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

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年四季度,国内外宏观经济走势和政策将成为影响股市市场的主要因素,海外方面,美联储在年内可能加息,地缘政治中可能影响商品价格产生冲击,各种政策、经济数据影响市场情绪,国内方面,3季度稳增长政策持续发力,央行可能有效提高人民币利率,人民币可能加入SDR,这些都将影响股市市场走势。

综合当前国内外经济和货币环境,预计4季度仍将维持稳健货币政策的基调,并随着国内外经济状况进行动态调整;通过公开市场操作等政策工具引导市场利率。

针对上述复杂的市场环境,本基金将持续跟踪市场,强化投资组合流动性,以确保组合安全性和流动性为主要任务,兼顾收益性,密切关注各项宏观经济数据,政策调整和市场资金面情况,平衡组合流动性与债券投资,谨慎控制组合的信用风险,保持合理流动性资产比例,精细化管理风险,以控制利率风险和组合内资产波动,努力为客户创造主动稳定的收益。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

注:本基金投资组合中公允价值计量为15.2361亿元,公允价值计量资产占基金总资产的99.99%。

5.2 投资组合报告

5.2.1 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。

5.2.2 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.4 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。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

5.2.7 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。

5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同约定规定备选股票库之外的股票。

5.2.8.2 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同约定规定备选股票库之外的股票。

5.2.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

5.4 管理人对报告期内基金运作情况的说明

5.4.1 基金运作分析

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。

5.4.2 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

5.4.3 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 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年3季度,货币市场受到多重因素影响呈现前低后高的走势,银行间市场隔夜回购利率从7月初的2.9%快速回落至11%左右,7天回购利率则基本稳定在2.5%附近。

3季度,本基金主要持仓短期国债和同业存款,管理现金流,保障组合充足流动性,整体看,3季度本基金仓位、流动性及风险控制良好,为下一阶段抓住市场机遇,创造主动收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金基金份额净值收益率为0.9031%,同期业绩比较基准收益率为0.3419%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

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年四季度,国内外宏观经济走势和政策将成为影响股市市场的主要因素,海外方面,美联储在年内可能加息,地缘政治中可能影响商品价格产生冲击,各种政策、经济数据影响市场情绪,国内方面,3季度稳增长政策持续发力,央行可能有效提高人民币利率,人民币可能加入SDR,这些都将影响股市市场走势。

综合当前国内外经济和货币环境,预计4季度仍将维持稳健货币政策的基调,并随着国内外经济状况进行动态调整;通过公开市场操作等政策工具引导市场利率。

针对上述复杂的市场环境,本基金将持续跟踪市场,强化投资组合流动性,以确保组合安全性和流动性为主要任务,兼顾收益性,密切关注各项宏观经济数据,政策调整和市场资金面情况,平衡组合流动性与债券投资,谨慎控制组合的信用风险,保持合理流动性资产比例,精细化管理风险,以控制利率风险和组合内资产波动,努力为客户创造主动稳定的收益。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

注:本基金投资组合中公允价值计量为15.2361亿元,公允价值计量资产占基金总资产的99.99%。

5.2 投资组合报告

5.2.1 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。

5.2.2 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

Table with 5 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.4 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。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with 5 columns: 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(%)

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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。

5.2.7 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。

5.2.8 投资组合报告附注

5.2.8.1 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同约定规定备选股票库之外的股票。

5.2.8.2 报告期内基金投资的前十名证券,没有投资超出基金合同约定规定备选股票库之外的股票。

5.2.8.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.3 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

5.4 管理人对报告期内基金运作情况的说明

5.4.1 基金运作分析

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。

5.4.2 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

5.4.3 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 异常交易专项说明

报告期内,本基金未发生法律法规及中国证监会禁止的异常交易行为;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超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年3季度,货币市场受到多重因素影响呈现前低后高的走势,银行间市场隔夜回购利率从7月初的2.9%快速回落至11%左右,7天回购利率则基本稳定在2.5%附近。

3季度,本基金主要持仓短期国债和同业存款,管理现金流,保障组合充足流动性,整体看,3季度本基金仓位、流动性及风险控制良好,为下一阶段抓住市场机遇,创造主动收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的投资组合报告

报告期内,本基金基金份额净值收益率为0.9031%,同期业绩比较基准收益率为0.3419%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警情况说明

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年四季度,国内外宏观经济走势和政策将成为影响股市市场的主要因素,海外方面,美联储在年内可能加息,地缘政治中可能影响商品价格产生冲击,各种政策、经济数据影响市场情绪,国内方面,3季度稳增长政策持续发力,央行可能有效提高人民币利率,人民币可能加入SDR,这些都将影响股市市场走势。

综合当前国内外经济和货币环境,预计4季度仍将维持稳健货币政策的基调,并随着国内外经济状况进行动态调整;通过公开市场操作等政策工具引导市场利率。

针对上述复杂的市场环境,本基金将持续跟踪市场,强化投资组合流动性,以确保组合安全性和流动性为主要任务,兼顾收益性,密切关注各项宏观经济数据,政策调整和市场资金面情况,平衡组合流动性与债券投资,谨慎控制组合的信用风险,保持合理流动性资产比例,精细化管理风险,以控制利率风险和组合内资产波动,努力为客户创造主动稳定的收益。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

注:本基金投资组合中公允价值计量为15.2361亿元,公允价值计量资产占基金总资产的99.99%。

5.2 投资组合报告

5.2.1 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。

5.2.2 报告期末按公允价值占