

中国人寿养老保险股份有限公司集合型企业年金计划管理情况

2016年4季度

一、2016年4季度集合计划基本情况表

序号	计划登记号	计划名称	期末企业数 (个)	期末职工人数 (人)	期末资产金额(万 元)	设立组合数 (个)	本期投资收益 (万元)	本年累计投资 收益(万元)
1	99JH20110024	国寿永信企业年金集合计划	100	12,809	31,718.81	5	179.54	478.47
2	99JH20110025	国寿永通企业年金集合计划	416	31,794	81,236.78	6	-123.70	885.10
3	99JH20110026	国寿永颐企业年金集合计划	418	71,174	179,754.56	5	-1,002.77	221.95
4	99JH20110027	国寿永睿企业年金集合计划	707	156,215	525,480.20	7	-292.16	8,214.96
5	99JH20110028	国寿永丰企业年金集合计划	1,823	203,570	489,611.53	6	-847.45	6,723.94
6	99JH20110029	国寿永诚企业年金集合计划	657	87,917	213,872.78	5	-393.25	2,979.49
7	99JH20120043	国寿永富企业年金集合计划	74	7,013	20,399.06	6	-63.40	80.63
8	99JH20120044	国寿永祥企业年金集合计划	176	13,355	36,887.06	6	-97.91	160.65
9	99JH20120045	国寿永福企业年金集合计划	57	9,165	48,568.88	6	-203.03	411.30
10	99JH20140048	国寿永乐企业年金集合计划	69	4,771	16,688.15	6	-16.93	234.17
合计	—	—	4,497	597,783	1,644,217.81	58	-2,861.06	20,390.67

注：1. 期末资产金额包含受托户资金余额。

2. 投资收益为所有组合投资收益合计数。投资收益=当期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。本期投资收益以本季度为期间，本年累计投资收益以年初到本季度末为期间。

二、2016年4季度集合计划组合明细表

序号	计划登记号	计划名称	组合序号	组合名称	组合类型	组合代码	投资管理公司名称	组合期末资产净值 (万元)	本年以来投资 收益率(%)
1	99JH20110024	国寿永信 企业年金 集合计划	1	稳健配置-国寿养老	含权益类	520280	中国人寿养老保险股份有限公司	17,799.57	2.33
			2	价值成长-国寿养老	含权益类	520286	中国人寿养老保险股份有限公司		
			3	避险增值-国寿养老	固定收益类	520299	中国人寿养老保险股份有限公司	12,883.10	0.81
			4	价值成长-工银瑞信(未 投资)	含权益类	-	工银瑞信基金管理有限公司		
			5	价值成长-南方基金(未 投资)	含权益类	-	南方基金管理有限公司		
2	99JH20110025	国寿永通 企业年金 集合计划	1	避险增值-国寿养老	固定收益类	520283	中国人寿养老保险股份有限公司	8,967.05	2.34
			2	价值成长-国寿养老(未 投资)	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			3	稳健配置-国寿养老	含权益类	520272	中国人寿养老保险股份有限公司	67,223.92	0.92
			4	价值成长-银华基金(未 投资)	含权益类	-	银华基金管理有限公司		
			5	价值成长-广发基金(未 投资)	含权益类	-	广发基金管理有限公司		
			6	价值成长-太平养老	含权益类	451276	太平养老保险股份有限公司	2,126.21	2.50
3	99JH20110026	国寿永颐 企业年金 集合计划	1	稳健配置-国寿养老	含权益类	520288	中国人寿养老保险股份有限公司	159,957.69	0.03
			2	避险增值-国寿养老	固定收益类	520434	中国人寿养老保险股份有限公司	7,447.04	2.56
			3	价值成长-国寿养老(未 投资)	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			4	价值成长-富国基金(未 投资)	含权益类	-	富国基金管理有限公司		
			5	价值成长-国泰基金(未 投资)	含权益类	-	国泰基金管理有限公司		

4	99JH20110027	国寿永睿企业年金集合计划	1	稳健配置-国寿养老	含权益类	520273	中国人寿养老保险股份有限公司	382,933.56	1.76
			2	价值成长-国寿养老	含权益类	520274	中国人寿养老保险股份有限公司	3,938.04	0.51
			3	避险增值-国寿养老	固定收益类	520285	中国人寿养老保险股份有限公司	82,845.54	2.68
			4	货币增利-国寿养老	固定收益类	520322	中国人寿养老保险股份有限公司	11,926.04	3.37
			5	价值成长-平安养老	含权益类	440374	平安养老保险股份有限公司	4,613.00	-2.35
			6	价值成长-易方达基金(未投资)	含权益类	-	易方达基金管理有限公司		
			7	价值成长-嘉实基金(未投资)	含权益类	-	嘉实基金管理有限公司		
5	99JH20110028	国寿永丰企业年金集合计划	1	稳健配置-国寿养老	含权益类	520269	中国人寿养老保险股份有限公司	389,507.12	1.40
			2	价值成长-国寿养老	含权益类	520271	中国人寿养老保险股份有限公司	1,645.68	-0.57
			3	价值成长-平安养老	含权益类	440398	平安养老保险股份有限公司	3,632.73	1.23
			4	价值成长-博时基金(未投资)	含权益类	-	博时基金管理有限公司		
			5	价值成长-中信证券(未投资)	含权益类	-	中信证券股份有限公司		
			6	避险增值-国寿养老	固定收益类	520290	中国人寿养老保险股份有限公司	66,955.73	2.39
6	99JH20110029	国寿永诚企业年金集合计划	1	价值成长-国寿养老(未投资)	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			2	稳健配置-国寿养老	含权益类	520279	中国人寿养老保险股份有限公司	166,126.36	1.32
			3	避险增值-国寿养老	固定收益类	520287	中国人寿养老保险股份有限公司	37,528.94	2.46
			4	价值成长-海富通基金(未投资)	含权益类	-	海富通基金管理有限公司		
			5	价值成长-华夏基金(未投资)	含权益类	-	华夏基金管理有限公司		

7	99JH20120043	国寿永富企业年金集合计划	1	价值成长（国寿）（未投资）	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			2	稳健配置（国寿）	含权益类	520281	中国人寿养老保险股份有限公司	17,686.70	0.12
			3	价值成长（易方达）（未投资）	含权益类	-	易方达基金管理有限公司		
			4	避险增值（国寿）（未投资）	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			5	价值成长（华夏）（未投资）	含权益类	-	华夏基金管理有限公司		
			6	货币增利（国寿）	固定收益类	520514	中国人寿养老保险股份有限公司	1,789.75	4.05
8	99JH20120044	国寿永祥企业年金集合计划	1	价值成长（国寿）（未投资）	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			2	稳健配置（国寿）	含权益类	520282	中国人寿养老保险股份有限公司	34,991.62	0.42
			3	避险增值（国寿）（未投资）	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			4	货币增利（国寿）（未投资）	固定收益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			5	价值成长（嘉实）（未投资）	含权益类	-	嘉实基金管理有限公司		
			6	价值成长（中信）（未投资）	含权益类	-	中信证券股份有限公司		
9	99JH20120045	国寿永福企业年金集合计划	1	货币增利（国寿）	固定收益类	520560	中国人寿养老保险股份有限公司	1,038.18	3.88
			2	稳健配置（国寿）	含权益类	520278	中国人寿养老保险股份有限公司	41,020.91	0.67
			3	避险增值（国寿）（未投资）	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			4	价值成长（银华）（未投资）	含权益类	-	银华基金管理有限公司		
			5	价值成长（博时）（未投资）	含权益类	-	博时基金管理有限公司		
			6	价值成长（银华）	含权益类	390045	银华基金管理有限公司	4,081.91	1.91

10	99JH20140048	国寿永乐企业年金集合计划	1	避险增值-国寿养老	固定收益类	520284	中国人寿养老保险股份有限公司	7,109.23	2.80
			2	稳健配置-国寿养老	含权益类	520275	中国人寿养老保险股份有限公司	8,696.46	1.00
			3	价值成长-国寿养老(未投资)	含权益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		
			4	价值成长-海富通基金(未投资)	含权益类	-	海富通基金管理有限公司		
			5	价值成长-南方基金(未投资)	含权益类	-	南方基金管理有限公司		
			6	货币增利-国寿养老(未投资)	固定收益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司		

注：1. 组合类型按是否含权益类投资标的分为固定收益类和含权益类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为固定收益类；没有明确约定或期间发生类别变动的，都为含权益类。

2. 本年以来投资收益率为该组合单位净值增长率。

对因分红、净值归一等非正常业务影响组合单位净值的，收益率分阶段计算。

(1) 分红情况

期间多段分红收益率公式： $R = \left(\frac{\text{期内第1次分红前一天单位净值}}{\text{期初单位净值}} \right) * \left(\frac{\text{期内第2次分红前一天单位净值}}{\text{期内第1次分红前一天单位净值} - \text{第一次单位份额分红金额}} \right) * \dots * \left(\frac{\text{期末单位净值}}{\text{期内第n次分红前一天单位净值} - \text{第n次单位份额分红金额}} \right) - 1$

其中，单位份额分红金额 = 分红当天分红金额 / 分红前总份额

(2) 净值归一情况

期间多段净值归一收益率公式： $R = \left(\frac{\text{期内第1次归一当天单位净值} * \text{第1次净值归一系数}}{\text{期初单位净值}} \right) * \left(\frac{\text{期内第2次归一当天单位净值} * \text{第2次净值归一系数}}{\text{期内第1次归一当天单位净值}} \right) * \dots * \left(\frac{\text{期末单位净值}}{\text{期内第n次归一当天单位净值}} \right) - 1$

其中，净值归一系数 = 净值归一当天总份额 / 净值归一前一天总份额

(3) 期内混合发生分红、净值归一时，按上述公式进行混合分段并计算期间收益率。

3. 本年以来投资收益空缺的为2015年1月1日及以后正式运作的组合。

三、2016年4季度集合计划分组合类型收益情况表

序号	计划登记号	计划名称	组合类型	样本组合数 (个)	样本组合期末资产净值 (万元)	本年以来加权平均 收益率(%)
1	99JH20110024	国寿永信企业年金集合计划	固定收益类	1	12,883.10	0.81
			含权益类	1	17,799.57	2.33
			综合	2	30,682.67	1.59
2	99JH20110025	国寿永通企业年金集合计划	固定收益类	1	8,967.05	2.34
			含权益类	2	69,350.12	0.96
			综合	3	78,317.17	1.12
3	99JH20110026	国寿永颐企业年金集合计划	固定收益类	1	7,447.04	2.56
			含权益类	1	159,957.69	0.03
			综合	2	167,404.74	0.12
4	99JH20110027	国寿永睿企业年金集合计划	固定收益类	2	94,771.58	2.74
			含权益类	3	391,484.60	1.70
			综合	5	486,256.18	1.90
5	99JH20110028	国寿永丰企业年金集合计划	固定收益类	1	66,955.73	2.39
			含权益类	3	394,785.53	1.39
			综合	4	461,741.26	1.53

6	99JH20110029	国寿永诚企业年金集合计划	固定收益类	1	37,528.94	2.46
			含权益类	1	166,126.36	1.32
			综合	2	203,655.30	1.54
7	99JH20120043	国寿永富企业年金集合计划	固定收益类	1	1,789.75	4.05
			含权益类	1	17,686.70	0.12
			综合	2	19,476.45	0.45
8	99JH20120044	国寿永祥企业年金集合计划	固定收益类	0	-	
			含权益类	1	34,991.62	0.42
			综合	1	34,991.62	0.42
9	99JH20120045	国寿永福企业年金集合计划	固定收益类	1	1,038.18	3.88
			含权益类	2	45,102.82	0.77
			综合	3	46,141.00	0.83
10	99JH20140048	国寿永乐企业年金集合计划	固定收益类	1	7,109.23	2.80
			含权益类	1	8,696.46	1.00
			综合	2	15,805.69	1.69
合计	——	——	固定收益类	10	238,490.60	2.46
			含权益类	16	1,305,981.47	1.24

注：1. 样本为2016年1月1日以前正式运作的投资组合。

2. 本年以来加权平均收益率计算方法为符合条件样本组合收益率的规模加权，以上年末和本年各季度末平均资产规模为权重；各组合收益率为单位净值增长率。