光大永明人寿保险有限公司投资连结保险投资账户半年度信息公告

2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

本信息公告依据中国保险监督管理委员会《中国保监会关于规范投资连结保险投资账户有关事项的通知》及《人身保险新型产品信息披露管理办法》编制并发布。

一、投资连结保险投资账户简介

光大永明人寿保险有限公司(以下简称"本公司")的投资连结保险投资账户是依照《投资连结保险管理暂行办法》等有关规定以及上述投资连结保险的有关条款,经向原中国保监会报批后设立。投资对象为银行存款、中国依法公开发行的证券投资基金、股票、原中国保监会允许投资的债券、资产管理理财产品、集合信托计划等其他金融工具。

投资连结保险投资账户由投资专业团队管理,本公司计划财务部独立分账管理。本公司的投资连结保险投资账户分为以下十二类:

1.稳健型投资账户

－设立时间:2002 年 9 月 16 日。

－账户特征:本账户安全性高、流动性强、收益率稳定。

－投资组合限制:投资于权益类投资资产的比例不高于 40%,债券和银行存款等固定收益类投资资产无限制。

－主要投资风险:来源于证券市场、债券市场、银行利率等方面,并可能受政治、经济、证券市场、政策法规等多项风险因素的影响。

2.平衡型投资账户

－设立时间:2002 年 9 月 16 日

－账户特征:本账户安全性较高、流动性较强、收益与风险平衡适中。

－投资组合限制:投资于权益类投资资产的比例不高于 70%,债券和银行存款等固定收益类投资资产无限制。

－主要投资风险:来源于证券市场、债券市场、银行利率等方面,并可能受政治、经济、证券市场、政策法规等多项风险因素的影响。

3.进取型投资账户

－设立时间:2002 年 9 月 16 日。

－账户特征:高风险高收益型投资账户。

－投资组合限制:投资于权益类投资资产的比例可达 100%,债券和银行存款等固定收益类投资资产无限制。

－主要投资风险:来源于证券市场、债券市场、银行利率等方面,并可能受政治、经济、证券市场、政策法规等多项风险因素的影响。

4.货币市场投资账户

－设立时间:2006 年 12 月 6 日。

－账户特征:本账户风险较低、收益稳定且具有较高的本金安全性。

－投资组合限制:本账户可投资于各种短期债券、银行存款、债券回购等货币市场工具

－主要投资风险:利率风险、信用风险等。

5.指数型投资账户

－设立时间:2006 年 12 月 6 日。

－账户特征:本账户以拟合目标指数、跟踪目标指数变化为原则,实现与市场同步成长为基本理念,力求投资组合的收益率拟合该目标指数所代表的资本市场的平均收益率。

－投资组合限制:运用于指数化投资部分不低于账户总资产的 85%,所持有现金、银行存款、债券等部分资产不高于账户总资产的 15%。

－主要投资风险:跟踪指数的被动投资风险、跟踪指数不尽合理的风险、流动性风险、市场风险、信用风险等。

6.策略账户

－设立时间:2011 年 10 月 27 日。

－账户特征:本账户以权益类投资资产为主要投资方向,本账户适合对于收益预期较高,同时风险承受能力很强的投资者。

－投资组合限制:权益类投资资产最高可达 100%,固定收益类投资资产无限制,所持有定向增发股票不超过账户总资产的 60% 。账户管理人可以根据政策和市场的具体形势,在预先公告后调整投资比例。

－主要投资风险:账户的主要风险来自于权益类投资资产的价格波动带来的市场风险,固定收益类资产的利率风险及信用风险。

7.优选投资账户

－设立时间:2014 年 1 月 1 日。

－账户特征:以为投资者提供相对长期、稳健且具有一定吸引力的投资收益为主要目的,本账户适合对于收益有一定预期、对资产流动性要求不高、风险承受能力适中的投资者。

－投资组合限制:货币市场工具、1 年以内的银行存款、1 年以内的债券、以及以现金管理为目的的保险资产管理产品份额和以现金管理为目的的债券型基金等以流动性管理为目的的资产,比例不低于 5%;权益类不超过 10%;1 年以上债券、银行存款、非以现金管理为目的的债券型基金、固定收益类资产管理产品不超过 90%;其他金融资产的投资余额不超过 75%。

－主要投资风险:账户的主要风险来自于固定收益类资产的利率风险及信用风险、权益类投资资产的价格波动带来的市场风险以及另类资产的信用风险和流动性风险。

8.财富稳定收益投资账户

－设立时间:2014 年 5 月 14 日。

－账户特征:本账户以为投资者提供流动性管理服务为主要目的,并在此基础上同时提供一定的收益,本账户适合对于有一定收益预期,同时风险承受能力较低的投资者。

－投资组合限制:货币市场工具、1 年以内的银行存款、1 年以内的债券、以及以现金管理为目的的保险资产管理产品份额和以现金管理为目的的债券型基金,合计不低于 90%;其他资产合计不超过 10%。

－主要投资风险:账户的主要风险为市场风险、信用风险和流动性风险。

9.光明 1 号账户

－设立时间:2016 年 12 月 6 日。

－账户特征:本账户以为投资者提供相对长期、稳健且具有一定吸引力的投资收益为主要目的,本账户适合对于收益有一定预期、对资产流动性要求适中、风险承受能力适中的投资者。

－投资组合限制:货币市场工具、1 年以内的银行存款、货币市场类保险资产管理产品和以现金管理为目的的债券、债券型基金等流动性资产,合计不低于账户价值的 5%。权益类不超过 10%。1 年以上债券、银行存款、非以现金管理为目的的债券型基金、固定收益类资产管理产品的比例范围在 0%-90%。其他金融资产的投资余额不超过账户价值的 75%。

－主要投资风险:账户的主要风险来自于固定收益类资产的利率风险及信用风险、权益类投资资产的价格波动带来的市场风险以及另类资产的信用风险和流动性。

10.光明 2 号账户

－设立时间:2016 年 12 月 6 日。

－账户特征:本账户以为投资者提供流动性管理服务为主要目的,并在此基础上同时提供一定的收益,本账户适合对于有一定收益预期,同时风险承受能力较低的投资者。

－投资组合限制:货币市场工具、1 年以内的银行存款、货币市场类保险资产管理产品、债券、债券型基金等以流动性管理为目的的资产比例合计不低于 5%。1 年以上债券、银行存款和非以现金管理为目的的债券型基金、固定收益类保险资产管理产品的比例范围在 0%-95%。其他金融资产的投资余额不超过账户价值的 75%。

－主要投资风险:账户的主要风险来自于固定收益类资产的利率风险及信用风险、权益类投资资产的价格波动带来的市场风险以及另类资产的信用风险和流动性。

11.光明 3 号账户

－设立时间:2017 年 4 月 27 日。

－账户特征:本账户以为投资者提供相对长期、稳健且具有一定吸引力的投资收益为主要目的,本账户适合对于收益有一定预期、对资产流动性要求不高、风险承受能力适中的投资者。

－投资组合限制:货币市场工具、1 年以内的银行存款、货币市场类保险资产管理产品和以现金管理为目的的债券、债券型基金等流动性资产,合计不低于账户价值的 5%。权益类不超过 10%。1 年以上债券、银行存款、非以现金管理为目的的债券型基金、固定收益类资产管理产品的比例范围在 0%-90%。其他金融资产的投资余额不超过账户价值的 75%。

－主要投资风险:账户的主要风险来自于固定收益类资产的利率风险及信用风险、权益类投资资产的价格波动带来的市场风险以及另类资产的信用风险和流动性。

－账户特征:本账户以为投资者提供相对长期、稳健且具有一定吸引力的投资收益为主要目的,本账户适合对于收益有一定预期、对资产流动性要求不高、风险承受能力适中的投资者。

－投资组合限制:货币市场工具、1 年以内的银行存款、货币市场类保险资产管理产品和以现金管理为目的的债券、债券型基金等流动性资产,合计不低于账户价值的 5%。权益类不超过 10%。1 年以上债券、银行存款、非以现金管理为目的的债券型基金、固定收益类资产管理产品的比例范围在 0%-95%。其他金融资产的投资余额不超过账户价值的 75%。

－主要投资风险:账户的主要风险来自于固定收益类资产的利率风险及信用风险、权益类投资资产的价格波动带来的市场风险以及另类资产的信用风险和流动性。

本公司投资连结保险主要包括:光大永明光明财富 3 号 E 款养老年金保险(投资连结型)、光大永明光明财富 3 号 A 款两全保险(投资连结型)、光大永明光明财富 3 号 B 款两全保险(投资连结型)、光大永明光明财富 3 号 C 款两全保险(投资连结型)和光大永明光明财富 4 号 A 款年金保险(投资连结型)等。

二、投资连结保险投资账户资产负债表

光大永明人寿保险有限公司

投资连结保险投资账户资产负债表

2020 年 6 月 30 日

(人民币万元)

	稳健账户	平衡账户	进取账户	货币账户	指数账户	策略账户	稳定收益	优选账户	光明1号	光明2号	光明3号	光明4号	合计
资产													
货币资金	193.13	497.83	42.30	59.16	455.24	31.46	700.51	1,242.12	3,169.93	2,291.01	88.67	0.10	8,771.46
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	1,456.37	6,612.44	13,254.74	592.47	1,222.78	–	54,288.20	7,110.25	18,770.14	125,958.29	–	–	229,265.68
可供出售金融资产	–	–	–	–	–	–	–	71,374.00	–	40,000.00	–	–	111,374.00
应收款项类投资	–	–	–	–	–	–	836.39	54,966.91	20,500.00	50,000.00	–	–	126,303.30
买入返售金融资产	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
应收利息	11.83	66.40	280.36	0.02	0.03	–	178.15	6,729.07	44.47	2,809.91	0.01	–	10,120.25
应收红利	0.14	0.72	1.11	0.34	–	–	1.60	13.59	0.79	3.79	–	–	22.08
其他应收款	–	–	–	–	–	–	–	5,000.00	1,072.95	1,000.00	–	–	7,072.95
													–
资产合计	1,661.47	7,177.39	13,578.51	651.99	1,678.05	31.46	56,004.85	146,435.94	43,558.28	222,063.00	88.68	0.10	492,929.72

光大永明人寿保险有限公司

投资连结保险投资账户资产负债表

2020 年 6 月 30 日

(人民币万元)

	稳健账户	平衡账户	进取账户	货币账户	指数账户	策略账户	稳定收益	优选账户	光明1号	光明2号	光明3号	光明4号	合计
负债与投资账户持有人权益													
卖出回购金融资产款	–	–	1,349.00	–	–	–	–	–	–	35,972.35	–	–	37,321.35
应付利息	–	–	0.08	–	–	–	–	–	–	12.10	–	–	12.18
应交税费	–	–	–	–	–	–	–	–	–	10.49	–	–	10.49
预提费用	2.52	9.30	17.70	0.69	3.33	0.04	7.44	133.63	205.72	9.99	0.04	–	390.40
其他应付款	153.14	34.18	165.45	27.20	4.63	–	13,197.05	–12,528.68	–77,955.42	79,728.16	–	–	2,829.71
										–			–
负债合计	155.66	43.48	1,532.23	27.89	7.96	0.04	13,197.49	–12,388.05	–77,745.70	115,733.09	0.04	–	40,564.13
投资账户持有人权益													
累计净资产	1,505.81	7,133.91	12,046.28	624.10	1,670.09	31.42	42,807.36	158,823.99	121,303.98	106,329.91	88.64	0.10	452,365.59
负债与投资账户持有人权益合计	1,661.47	7,177.39	13,578.51	651.99	1,678.05	31.46	56,004.85	146,435.94	43,558.28	222,063.00	88.68	0.10	492,929.72

三、投资连结保险投资账户收益表

光大永明人寿保险有限公司

投资连结保险投资账户投资收益表

2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

(人民币万元)

	稳健账户	平衡账户	进取账户	货币账户	指数账户	策略账户	稳定收益	优选账户	光明1号	光明2号	光明3号	光明4号	合计
收益													
利息收入	29.41	70.91	345.85	0.23	0.35	0.05	37.61	2,912.81	743.07	4,803.00	0.10	–	8,943.39
投资收益/(损失)	4.43	227.24	–122.05	5.92	224.39	–	–435.10	767.61	1,510.67	3,277.68	1.66	–	5,462.45
公允价值变动(损失)/收益	–15.20	602.39	148.24	–	164.94	–	3,314.67	481.33	–605.13	–1,942.13	–1.23	–	1,185.22
其他收益	–	–	–	–	–	–	–	–	–	485.50	–	–	485.50
收益小计	18.64	900.54	372.04	6.15	389.68	0.05	2,917.18	3,199.09	1,648.61	6,624.05	0.53		16,076.56
费用													
投资账户资产管理费	11.96	49.97	92.03	3.18	10.18	0.27	65.07	782.30	827.14	112.38	0.23	–	1,954.71
营业税金及附加	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
利息支出	–	–	45.08	–	–	–	–	–	–	376.08	–	–	421.17
其他费用	0.32	0.42	0.98	0.05	0.69	0.04	5.32	9.67	6.16	29.32	0.94	0.94	54.85
费用小计	12.28	50.39	138.11	3.23	10.87	0.31	70.39	791.97	833.30	517.78	1.17	0.94	2,430.73
净(损失)/收益	6.36	850.15	233.93	2.92	378.81	–0.26	2,846.79	2,407.12	815.31	6,106.27	–0.64	–0.94	13,645.82

四、其他

(一)账户资产估值原则

投连各账户资产于评估基准日按如下原则进行估值:

1、证券交易所上市的有价证券的估值:

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(2)债券估值方法:

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,选取中央国债登记结算公司(以下简称"中债登")提供的相应品种当日的估值净价估值。对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取中债登提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。

对在交易所市场上市交易的可转换债券,选取每日收盘价作为估值全价。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券,或在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,选取中债登提供的相应品种当日的估值净价估值;如无中债登估值,按成本估值。

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券,选取中债登提供的相应品种当日的估值净价估值;如无中债登估值,按成本估值。

对银行间市场上不含权的固定收益品种,选取中债登提供的相应品种当日的估值净价;对银行间市场上含权的固定收益品种,建议选取中债登提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值;

(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的估值方法估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、持有的开放式基金,以其公告的基金单位净值估值;

5、持有的处于募集期内的证券投资基金,按其成本估值;

6、定向增发股票的估值方法

我公司参照中国证监会《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》中对非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法进行估值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价,采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价,按以下公式确定该股票的价值:

FV=C+(P－C)×(D1－Dr)／D1

其中:

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值;

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本(因权益业务导致市场价格除权时,应于除权日对其初始取得成本作相应调整);

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价;

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数;

Dr 为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数(不含估值日当天)。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

(二)报告期末投资组合(单位元)及占比状况

各账户期末投资组合情况:

	稳健账户	
	市值	占比
货币资金	1,931,259.81	11.62%
应收利息	118,277.97	0.71%
基金	3,707,982.91	22.32%
债券	10,855,719.00	65.34%
应收股利	1,414.70	0.01%
合计	16,614,654.39	100.00%
	平衡账户	
	市值	占比
货币资金	4,978,290.47	6.94%
应收利息	663,914.09	0.93%
基金	5,131,108.81	7.15%
债券	31,116,332.00	43.35%
理财产品	29,876,956.96	41.63%
应收股利	7,234.44	0.01%
合计	71,773,836.77	100.00%
	进取账户	
	市值	占比
货币资金	422,962.60	0.31%
应收利息	2,803,629.66	2.06%
基金	7,840,718.89	5.77%
债券	124,706,649.00	91.84%
应收股利	11,136.21	0.01%
合计	135,785,096.36	100.00%
	货币账户	
	市值	占比
货币资金	591,496.11	9.07%
应收利息	162.73	0.00%
基金	5,924,666.02	90.87%
应收股利	3,373.91	0.05%
合计	6,519,698.77	100.00%
	指数账户	
	市值	占比
货币资金	4,552,442.19	27.13%
应收利息	323.89	0.00%
股票	12,227,771.00	72.87%
基金	2.12	0.00%
合计	16,780,539.20	100.00%
	策略账户	
	市值	占比
货币资金	314,573.77	99.99%
应收利息	26.20	0.01%
合计	314,599.97	100.00%
	优选账户	
	市值	占比
货币资金	12,421,208.07	0.85%
应收利息	67,290,613.25	4.60%
基金	5,159,107.73	0.35%
资管产品	65,943,391.75	4.50%
信托产品	863,409,104.03	58.96%
股权基金	400,000,000.00	27.32%
应收股利	135,940.23	0.01%
应收款项	50,000,000.00	3.41%
合计	1,464,359,365.06	100.00%
	稳定收益账户	
	市值	占比
货币资金	7,005,051.81	1.25%
应收利息	1,781,534.41	0.32%
基金	227,401,375.73	40.60%
资管产品	315,480,625.96	56.33%
信托产品	8,363,942.14	1.49%
应收股利	15,978.24	0.00%
合计	560,048,508.29	100.00%
	光明 1 号账户	
	市值	占比
货币资金	31,699,267.93	7.28%
应收利息	444,721.98	0.10%
基金	74,400,106.39	17.08%
理财产品	113,301,329.51	26.01%
信托产品	205,000,000.00	47.06%
应收股利	7,941.16	0.00%
应收款项	10,729,500.00	2.46%
合计	435,582,866.97	100.00%
	光明 2 号账户	
	市值	占比
货币资金	22,910,181.10	1.03%
应收利息	28,099,099.89	1.27%
基金	20,241,064.42	0.91%
理财产品	720,403,786.43	32.44%
信托产品	500,000,000.00	22.52%
债券	918,938,084.23	41.38%
应收股利	37,888.08	0.00%
应收款项	10,000,000.00	0.45%
合计	2,220,630,104.15	100.00%
	光明 3 号账户	
	市值	占比
货币资金	886,654.02	99.99%
应收利息	73.89	0.01%
合计	886,727.91	100.00%
	光明 4 号账户	
	市值	占比
货币资金	1,005.28	99.99%
应收利息	0.10	0.01%
合计	1,005.38	100.00%

股票资产中各行业股票市值及占比:

股票类别	市值	占比
交通运输、仓储和邮政业	309,901.00	2.53%
制造业	5,995,070.00	49.03%
建筑业	970,000.00	7.93%
信息传输、软件和信息技术服务业	2,891,830.00	23.65%
金融业	969,600.00	7.93%
科学研究和技术服务业	1,091,370.00	8.93%
总计	12,227,771.00	100.00%

债券资产中各类债券账面余额及占比:

债券类别	市值	占比
政策性金融债	82,652,750.00	7.61%
中期票据	375,220,610.00	34.56%
企业债	194,140,800.00	17.88%
可转债	3,528,861.61	0.33%
可交换债	9,858,362.62	0.91%
地方政府债	9,698,000.00	0.89%
公司债	241,264,400.00	22.22%
其他	169,253,000.00	15.59%
合计	1,085,616,784.23	100.00%

不同信用等级的债券账面余额及占比:

债券信用等级	市值	占比
AA+	283,559,005.00	26.12%
AAA	367,542,968.40	33.86%
其他	434,014,810.83	39.98%
合计	1,085,616,784.23	100.00%

基金资产中各类基金净值及占比:

基金类别		市值	占比
开放式	开放式基金 _ 股票型	88,554,199.33	25.32%
	开放式基金 _ 混合型	85,147,685.45	24.34%
	开放式基金 _ 货币型	57,185,048.32	16.35%
	开放式基金 _ 债券型	118,919,199.92	34.00%
	LOF 基金 _ 股票型		0.00%
合计		349,806,133.02	100.00%

(三)投资单位数

投资连结保险投资账户 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日投资单位数变动如下:

投资单位数	稳健账户	平衡账户	进取账户	货币账户	指数账户	策略账户	稳定收益	优选	光明1号	光明2号	光明3号	合计
于2019年12月31日	6,730,772.41	16,000,729.33	16,169,976.29	4,734,049.77	10,590,381.52	253,882.06	618,861,237.68	1,305,381,150.22	765,949,644.52	2,521,355,026.96	843,761.53	5,266,870,612.29
本年增加/(减少)单位数	–451,968.59	–401,389.14	–468,441.08	–223,854.08	–1,048,742.14	–0.00	–310,574,031.37	–122,109,297.45	–337,355,354.73	–1,633,750,598.56	0.00	–1,731,672,967.70
于2020年6月30日	6,278,803.82	15,599,340.19	15,701,535.21	4,510,195.69	9,541,639.38	253,882.06	308,287,206.31	1,183,272,852.77	1,103,304,999.25	887,604,428.40	843,761.53	3,535,198,644.59

注:以上期末数据取本期最后一个工作日 2019 年 6 月 30 日数据。

(四)投资回报率

$$投资回报率 = \frac{(期末卖出价 - 期初卖出价)}{期初卖出价} \times 100\%$$

账户设立日期	稳健账户 2002/9/16	平衡账户 2002/9/16	进取账户 2002/9/16	货币市场 2006/12/6	指数账户 2006/12/6	策略账户 2011/10/27	稳定收益 2014/5/14	优选账户 2014/1/1	光明1号 2016/12/6	光明2号 2016/12/6	光明3号 2017/4/27
2002	0.55%	0.02%	–0.37%								
2003	3.42%	5.11%	6.80%								
2004	1.42%	0.76%	0.86%								
2005	2.44%	2.38%	3.90%								
2006	26.55%	30.11%	52.51%	0.00%	0.00%						
2007	36.85%	43.13%	63.12%	0.76%	89.93%						
2008	–3.56%	–17.68%	27.95%	2.25%	–61.27%						
2009	11.34%	29.74%	45.41%	0.63%	79.80%						
2010	1.61%	0.80%	–1.01%	1.46%	–14.08%						
2011	–3.42%	–12.38%	–20.41%	2.79%	–22.21%	0.09%					
2012	13.15%	–7.81%	10.74%	4.72%	1.41%	8.47%					
2013	0.98%	2.05%	10.61%	4.03%	–15.46%	–7.44%					
2014	19.34%	23.51%	21.28%	4.50%	36.62%	–6.44%	2.42%	6.03%			
2015	5.33%	51.80%	99.37%	2.26%	29.17%	43.17%	1.90%	3.32%			
2016	–4.15%	–0.27%	0.16%	1.21%	–12.66%	0.34%	2.01%	3.35%			
2017	–0.22%	3.52%	0.76%	0.91%	1.21%	–1.79%	2.93%	2.09%	1.16%	2.15%	
2018	1.74%	2.28%	2.60%	1.46%	–8.36%	–0.77%	3.48%	1.96%	1.49%	2.94%	
2019	4.65%	1.70%	5.71%	1.71%	11.24%	–1.52%	3.17%	2.60%	3.02%	5.28%	5.15%
2020	2.4%	23.21%	4.3%	1.08%	53.09%	–1.54%	9.24%	3.29%	2.15%	5.38%	–0.1%

注:货币市场账户自设立截止到二零零七年五月九日,回报率为 0.58%,自二零零七年五月二十三日至二零零七年十二月三十一日,回报率为 0.76% ,中间阶段因账户价值被全部提取,无回报率。

(五)投资账户资产管理费

投资账户管理费是根据本公司投资连结保险条款规定,以投资账户资产价值的一定比例收取,主要用于负担本公司对投资连结保险投资账户进行投资管理的营运费用。本公司 2018 年度的投资连结保险投资账户管理费如下:稳健账户年费率为 1.50%,平衡账户年费率为 1.50%,进取账户年费率为 1.50%,货币账户年费率为 1.00%,指数账户年费率为 1.50%,策略账户年费率为 1.70%, 稳定收益账户年费率为 0.2%, 优选账户年费率为 1.00% ,光明 1 号账户年费率为 2%,光明 2 号年费率为 0.1%,光明 3 号及 4 号账户年费率为 0.5%。

(六)托管行情况

截止 2020 年 6 月底,本公司投连托管行分别为中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司。

(七)其他

光大永明人寿保险有限公司

2020 年 7 月 10 日

南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")的有关规定,现将南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")基金份额持有人大会的决议及相关事项公告如下:

一、本次基金份额持有人大会会议情况

南方基金管理股份有限公司(以下简称"本公司"或"基金管理人")旗下南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金以通讯开会方式召开了基金份额持有人大会,权益登记日为 2020 年 6 月 5 日。大会表决投票时间自 2020 年 6 月 5 日起至 2020 年 7 月 20 日 17:00 止(投票表决时间以基金管理人收到表决票时间为准)。2020 年 7 月 21 日,在本基金的基金托管人招商银行股份有限公司授权代表的监督下,基金管理人对本次大会表决进行了计票,上海市通力律师事务所对计票过程进行了见证,北京市中信公证处对计票过程及结果进行了公证。

经统计,本次基金份额持有人大会出具表决意见的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额共计 203,871,200.00 份,占权益登记日本基金基金总份额份的 50.73%,达到法定开会条件,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定。

会议审议了《关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》(以下简称"本次会议议案"),并由出具表决意见的基金份额持有人或其代理人对本次会议议案进行表决。表决结果为:203,494,900.00 份基金份额同意,261,300.00 份基金份额反对,115,000.00 份基金份额弃权。同意本次大会议案的基金份额占出具表决意见的基金份额持有人或其代理人所代表的基金份额总数的的二分之一以上,符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本次会议议案获得通过。

本次基金份额持有人大会费用由基金资产列支,本次基金份额持有人大会律师费 4 万元,公证费 1 万元,合计为 5 万元。

二、本次基金份额持有人大会决议的生效

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,本次会议决议生效日为 2020 年 7 月 21 日。基金管理人将于表决通过之日起 5 日内报中国证监会备案。本次会议通过的表决事项为本公司于 2020 年 6 月 5 日在《证券日报》及基金管理人网站(www.nffund.com)发布的《南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》之附件《关于南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》。

三、持有人大会决议相关事项的实施情况

1、投资范围的修改安排

(1)根据本次会议议案,本基金将修改投资范围,并相应修订基金合同。修改后的投资范围具体如下:

"本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。

基金管理人根据相关规定可参与转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。"

(2)本基金托管协议及招募说明书将根据上述内容同步进行相应修改。

2、修改后的投资范围的执行

自本次基金份额持有人大会决议通过之日起,即 2020 年 7 月 21 日起,本基金执行修改后的投资范围。

四、备查文件

1、《南方基金管理股份有限公司关于以通讯方式召开南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告》

2、《公证书》

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2020 年 7 月 22 日

公 证 书

(2020)京中信内经证字32093号

申请人:南方基金管理股份有限公司,统一社会信用代码:91440300279533137K。住所:深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦32-42楼。

法定代表人:张海波,男,一九六三年九月九日出生,公民身份号码:[redacted]。

授权代理人:何路遥,男,一九九一年九月二十三日出生,公民身份号码:[redacted]。

授权代理人:常溪,女,一九八九年三月二日出生,公民身份号码:[redacted]。

公证事项:现场监督

申请人南方基金管理股份有限公司(以下简称为"申请人")于2020年06月04日委托何路遥、常溪向我处提出申请,对南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的会议过程和会议有关事宜进行公证监督。申请人向我处提交了企业法人营业执照、法定代表人身份证明,公证申请书、身份证、《关于南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》等证明材料。

经审查,申请人是南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金的管理人,为了维护基金份额持有人利益,申请人与该基金的基金托管人协商一致,决定召开该基金的基金份额持有人大会,审议《关于南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》。为了维护该基金基金份额持有人的合法权利,根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")及《南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称"《基金合同》")的有关规定,申请人决定以通讯方式召开该基金的基金份额持有人大会审议《关于南方中证1000交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》,由基金份额持有人就该议案进行表决。我处受理了申请人的申请并指派本公证员具体承办。

申请人经与有