

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

2022年3季度

一、2022年3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	99JH201100 24	国寿永信 企业年金 集合计划	400	26,113	120,494.71	5	-719.58	-588.19
2	99JH201100 25	国寿永通 企业年金 集合计划	694	50,869	220,339.48	5	-1,978.54	-2,739.57
3	99JH201100 26	国寿永颐 企业年金 集合计划	1,294	105,938	482,201.63	5	-2,617.04	-6,395.90
4	99JH201100 27	国寿永睿 企业年金 集合计划	2,012	202,964	1,237,440.48	8	-5,827.51	-9,772.33
5	99JH201100 28	国寿永丰 企业年金 集合计划	5,876	537,397	2,438,193.40	7	-16,521.11	-27,408.61

6	99JH201100 29	国寿永诚 企业年金 集合计划	1,519	158,298	682,064.00	6	-3,715.59	-13,019.99
7	99JH201200 43	国寿永富 企业年金 集合计划	168	15,038	67,003.09	6	-375.23	-295.04
8	99JH201200 44	国寿永祥 企业年金 集合计划	292	20,122	113,003.64	6	-918.27	-2,306.83
9	99JH201200 45	国寿永福 企业年金 集合计划	246	44,042	387,690.06	6	-5,971.22	-11,549.43
10	99JH201400 48	国寿永乐 企业年金 集合计划	152	15,179	102,723.93	6	-960.73	-1,886.12
11	合计	—	12,653	1,175,960	5,851,154.42	60	-39,604.82	-75,962.01

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、2022年3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	投资管理人名称	组合期末资产净值 (万元)	本年以来投资收益率 (%)
----	-----------	----------	----------	----------	----------	------	---------	------------------	------------------

1	99JH20110 024	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	I52Q0280	中国人寿养老保险股份有限公司	68,394.46	-2.24
			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	避险增值-国寿养老	固定收益类	I52Q0299	中国人寿养老保险股份有限公司	49,713.75	1.42
			4	价值成长-工银瑞信(未投资)	含权益类	I47Q0368	工银瑞信基金管理有限公司	144.45	-
			5	价值成长-南方基金(未投资)	含权益类	-	南方基金管理股份有限公司	-	-

2	99JH20110 025	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	I52Q0283	中国人寿养老保险股份有限公司	56,023.15	1.53
			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	I52Q0272	中国人寿养老保险股份有限公司	154,989.39	-2.46
			4	价值成长-银华基金	含权益类	I39Q0072	银华基金管理股份有限公司	531.59	-
			5	价值成长-太平养老	含权益类	I45Q1276	太平养老保险股份有限公司	4,924.47	-4.18
3	99JH20110 026	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	I52Q0288	中国人寿养老保险股份有限公司	314,698.03	-3.22

			2	避险增值-国寿养老	固定收益类	I52Q0434	中国人寿养老保险股份有限公司	120,863.68	1.67
			3	价值成长-国寿养老	含权益类	I52Q0761	中国人寿养老保险股份有限公司	27,243.76	1.40
			4	价值成长-富国基金	含权益类	I37Q0138	富国基金管理有限公司	6,084.68	-
			5	价值成长-国泰基金	含权益类	I46Q0055	国泰基金管理有限公司	303.34	2.02
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	I52Q0273	中国人寿养老保险股份有限公司	816,139.54	-1.80
			2	价值成长-国寿养老	含权益类	I52Q0274	中国人寿养老保险股份有限公司	5,389.83	-3.82
			3	避险增值-	固定收益类	I52Q0285	中国人寿养老保险股份有限公司	220,871.90	2.39

				国寿养老					
			4	货币增利-国寿养老	固定收益类	I52Q0322	中国人寿养老保险股份有限公司	66,429.84	1.91
			5	价值成长-平安养老	含权益类	I44Q0374	平安养老保险股份有限公司	0.43	-
			6	价值成长-易方达基金(未投资)	含权益类	I34Q0292	易方达基金管理有限公司	78.54	-
			7	价值成长-嘉实基金(未投资)	含权益类	I35Q0193	嘉实基金管理有限公司	55.69	-
			8	安享稳盈-国寿养老	含权益类	I52Q0700	中国人寿养老保险股份有限公司	109,716.37	-3.23

5	99JH20110 028	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	I52Q0269	中国人寿养老 保险股份有限公司	1,303,791.34	-2.86
			2	价值 成长- 国寿 养老	含权益 类	I52Q0271	中国人寿养老 保险股份有限公司	11,547.02	-3.26
			3	价值 成长- 平安 养老	含权益 类	I44Q0398	平安养老保险 股份有限公司	444.32	5.62
			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-	固定收 益类	I52Q0290	中国人寿养老 保险股份有限公司	885,408.14	1.87

			5	价值成长-华夏基金	含权益类	I32Q0286	华夏基金管理有限公司	716.66	-
			6	安享稳盈-国寿养老	含权益类	I52Q0712	中国人寿养老保险股份有限公司	49,587.97	-1.58
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	I52Q0281	中国人寿养老保险股份有限公司	37,448.85	-2.31
			3	价值成长（易方达）	含权益类	I34Q0287	易方达基金管理有限公司	1,018.88	-
			4	避险增值（国寿）	固定收益类	-	中国人寿养老保险股份有限公司	-	-

				(未投资)					
			5	价值成长 (华夏)	含权益类	I32Q0285	华夏基金管理有 限公司	162.90	-
			6	货币增利 (国寿)	固定收益类	I52Q0514	中国人寿养老保 险股份有限公司	26,333.74	2.02
8	99JH20120 044	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	I52Q0282	中国人寿养老保 险股份有限公司	110,070.25	-2.31
			3	避险增值 (国寿)	含权益类	I52Q0955	中国人寿养老保 险股份有限公司	59.56	-
			4	货币增利	固定收益类	-	中国人寿养老保 险股份有限公司	-	-

				(国 寿) (未投 资)					
			5	价值 成长 (嘉 实)	含权益 类	I35Q0192	嘉实基金管理有 限公司	85.27	0.92
			6	价值 成长 (中 信证 券)	含权益 类	I41Q0321	中信证券股份有 限公司	322.23	0.80
9	99JH20120 045	国寿永 福企业 年金集 合计划	1	货币 增利- 国寿 养老	固定收 益类	I52Q0951	中国人寿养老保 险股份有限公司	11,808.36	-
			2	价值 成长 (国 寿)	含权益 类	I52Q0717	中国人寿养老保 险股份有限公司	223,308.67	-3.62
			3	稳健 配置 (国 寿)	含权益 类	I52Q0278	中国人寿养老保 险股份有限公司	136,588.89	-1.82

			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（博时）	含权益类	I38Q2012	博时基金管理有限公司	175.02	-
			6	价值成长（银华）	含权益类	I39Q0045	银华基金管理股份有限公司	13,673.75	-7.13
10	99JH20140048	国寿永乐企业年金集合计划	1	中国人寿避险增值投资组合	固定收益类	I52Q0284	中国人寿养老保险股份有限公司	19,896.56	2.32
			2	中国人寿稳健配置组合	含权益类	I52Q0275	中国人寿养老保险股份有限公司	40,266.90	-3.47

			3	中国人寿价值成长组合	含权益类	I52Q0749	中国人寿养老保险股份有限公司	38,376.28	-2.88
			4	海富通价值成长投资组合(未投资)	含权益类	-	海富通基金管理有限公司	-	-
			5	南方价值成长投资组合(未投资)	含权益类	-	南方基金管理股份有限公司	-	-
			6	中国人寿货币增利投资组合	固定收益类	I52Q0713	中国人寿养老保险股份有限公司	975.24	2.07

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： $R = (\text{期内第1次分红前一天单位净值} / \text{期初单位净值}) * (\text{期内第2次分红前一天单位净值} / (\text{期内第1次分红前一天单位净值} - \text{第一次单位份额分红金额})) * \dots * (\text{期末单位净值} / (\text{期内第n次分红前一天单位净值} - \text{第n次单位份额分红金额})) - 1$

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： $R = ((\text{期内第1次归一当天单位净值} * \text{第1次净值归一系数}) / \text{期初单位净值}) * ((\text{期内第2次归一当天单位净值} * \text{第2次净值归一系数}) / \text{期内第1次归一当天单位净值}) * \dots * (\text{期末单位净值} / \text{期内第n次归一当天单位净值}) - 1$

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. 本年以来投资收益率空缺的为 2022 年 1 月 1 日及以后正式运作的组合。

三、2022 年 3 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	49,713.75	1.42
			含权益类	1	68,394.46	-2.24

			综合	2	118,108.21	-0.69
2	99JH20110025	国寿永通企业年金 集合计划	固定收益类	1	56,023.15	1.53
			含权益类	2	159,913.86	-2.52
			综合	3	215,937.01	-1.49
3	99JH20110026	国寿永颐企业年金 集合计划	固定收益类	1	120,863.68	1.67
			含权益类	3	342,245.13	-2.86
			综合	4	463,108.81	-1.70
4	99JH20110027	国寿永睿企业年金 集合计划	固定收益类	2	287,301.74	2.28
			含权益类	3	931,245.74	-1.96
			综合	5	1,218,547.48	-0.97
5	99JH20110028	国寿永丰企业年金 集合计划	固定收益类	1	885,408.14	1.87
			含权益类	4	1,495,922.41	-3.06
			综合	5	2,381,330.55	-1.30
6	99JH20110029	国寿永诚企业年金 集合计划	固定收益类	1	137,452.22	1.63
			含权益类	2	531,963.88	-3.26
			综合	3	669,416.10	-2.25
7	99JH20120043	国寿永富企业年金	固定收益类	1	26,333.74	2.02

		集合计划	含权益类	1	37,448.85	-2.31
			综合	2	63,782.59	-0.55
8	99JH20120044	国寿永祥企业年金集合计划	固定收益类	0	0.00	0.00
			含权益类	3	110,477.75	-2.30
			综合	3	110,477.75	-2.30
9	99JH20120045	国寿永福企业年金集合计划	固定收益类	0	0.00	0.00
			含权益类	3	373,571.31	-3.12
			综合	3	373,571.31	-3.12
10	99JH20140048	国寿永乐企业年金集合计划	固定收益类	2	20,871.80	2.31
			含权益类	2	78,643.18	-3.15
			综合	4	99,514.98	-2.11
11	合计	--	固定收益类	10	1,583,968.22	1.89
			含权益类	24	4,129,826.57	-2.77

注：1. 样本为 2022 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。