

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

2021 年 2 季度

一、2021 年 2 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	290	19,471	84,994.01	4	1,939.88	2,460.23
2	99JH201100 25	国寿永通 企业年金 集合计划	539	37,182	165,505.52	6	3,841.62	2,843.40
3	99JH201100 26	国寿永颐 企业年金 集合计划	1,020	97,557	360,977.20	5	10,820.44	12,120.93
4	99JH201100 27	国寿永睿 企业年金 集合计划	1,484	163,689	964,012.04	8	21,166.59	22,606.73
5	99JH201100 28	国寿永丰 企业年金 集合计划	4,807	458,224	1,867,245.46	7	42,857.05	46,038.05

6	99JH201100 29	国寿永诚 企业年金 集合计划	1,193	133,528	530,477.81	6	16,216.23	17,662.28
7	99JH201200 43	国寿永富 企业年金 集合计划	146	11,802	51,227.87	6	1,067.27	1,265.49
8	99JH201200 44	国寿永祥 企业年金 集合计划	260	18,222	88,069.53	6	3,126.00	3,993.14
9	99JH201200 45	国寿永福 企业年金 集合计划	109	35,480	333,188.42	5	10,400.44	11,394.93
10	99JH201400 48	国寿永乐 企业年金 集合计划	120	13,041	90,615.41	6	2,263.83	2,963.27
11	合计	—	9,968	988,196	4,536,313.27	59	113,699.35	123,348.45

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、2021 年 2 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	45,974.35	3.74
			2	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	38,020.45	2.31
			3	价值 成长- 工银 瑞信	含权益 类	-	工银瑞信基金管 理有限公司	-	-
			4	价值 成长- 南方 基金	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	41,185.15	2.24
			2	价值 成长- 国寿 养老	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	116,754.50	1.60
			4	价值成长-银华基金	含权益类	-	银华基金管理股份有限公司	-	-
			5	价值成长-广发基金	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	I45Q1276	太平养老保险股份有限公司	4,903.32	2.66
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	I52Q0288	中国人寿养老保险股份有限公司	255,304.39	4.35
			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	80,039.52	2.19

			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	15,320.97	2.17
			4	价值成长-富国基金	含权益类	-	富国基金管理有限公司	-	-
			5	价值成长-国泰基金	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	I52Q0273	中国人寿养老保险股份有限公司	677,855.55	2.73
			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	4,776.76	4.08
			3	避险增值-国寿养老	固定收益类	I52Q0285	中国人寿养老保险股份有限公司	181,353.81	1.67

			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	40,992.61	1.55
			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	5,820.29	0.98
			6	价值 成长- 易方 达基 金	含权益 类	-	易方达基金管理 有限公司	-	-
			7	价值 成长- 嘉实 基金	含权益 类	-	嘉实基金管理有 限公司	-	-
			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	34,174.75	3.04
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	1,096,479.76	2.91

			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	4,843.72	3.52
			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	2,955.61	1.58
			4	价值成长-博时基金	含权益类	-	博时基金管理有限公司	-	-
			5	价值成长-中信证券	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	I52Q0290	中国人寿养老保险股份有限公司	586,041.99	1.95
			7	安享稳盈-国寿养老	含权益类	I52Q0703	中国人寿养老保险股份有限公司	130,795.71	4.64

6	99JH20110 029	国寿永 诚企业 年金集 合计划	1	价值 成长- 国寿 养老	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	I52Q0279	中国人寿养老保 险股份有限公司	394,361.96	3.90
			3	避险 增值- 国寿 养老	固定收 益类	I52Q0287	中国人寿养老保 险股份有限公司	104,056.32	2.41
			4	价值 成长- 海富 通基 金	含权益 类	-	海富通基金管理 有限公司	-	-
			5	价值 成长- 华夏 基金	含权益 类	-	华夏基金管理有 限公司	-	-
			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	25,969.08	3.40

7	99JH20120 043	国寿永 富企业 年金集 合计划	1	价值 成长 （国 寿）	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	31,123.82	3.24
			3	价值 成长 （易 方达）	含权益 类	-	易方达基金管理 有限公司	-	-
			4	避险 增值 （国 寿）	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）	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	I52Q0514	中国人寿养老保 险股份有限公司	18,778.68	1.58

8	99JH20120 044	国寿永 祥企业 年金集 合计划	1	价值 成长 （国 寿）	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	86,453.92	4.78
			3	避险 增值 （国 寿）	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）	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）	含权益 类	-	嘉实基金管理有 限公司	-	-
			6	价值 成长 （中 信证 券）	含权益 类	-	中信证券股份有 限公司	-	-

9	99JH20120 045	国寿永 福企业 年金集 合计划	1	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	217,231.18	3.63
			2	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	97,568.89	4.28
			3	避险 增值 （国 寿）	含权益 类	-	中国人寿养老保 险股份有限公司	-	-
			4	价值 成长 （博 时）	含权益 类	-	博时基金管理有 限公司	-	-
			5	价值 成长 （银 华）	含权益 类	I39Q0045	银华基金管理股 份有限公司	12,760.67	1.68
10	99JH20140 048	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	13,671.25	2.89

			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	30,127.26	3.94
			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	43,241.43	3.77
			4	海富通价 值成长投 资组合	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	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	1,199.61	1.48
--	--	--	---	--------------	-------	----------	----------------	----------	------

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 2021 年 1 月 1 日及以后正式运作的组合。

三、2021 年 2 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	38,020.45	2.31
			含权益类	1	45,974.35	3.74
			综合	2	83,994.80	3.09
2	99JH20110025	国寿永通企业年金 集合计划	固定收益类	1	41,185.15	2.24
			含权益类	2	121,657.82	1.64
			综合	3	162,842.97	1.79
3	99JH20110026	国寿永颐企业年金 集合计划	固定收益类	1	80,039.52	2.19
			含权益类	2	270,625.36	4.24
			综合	3	350,664.88	3.77
4	99JH20110027	国寿永睿企业年金 集合计划	固定收益类	2	222,346.42	1.64
			含权益类	4	722,627.35	2.74
			综合	6	944,973.77	2.48
5	99JH20110028	国寿永丰企业年金 集合计划	固定收益类	1	586,041.99	1.95
			含权益类	4	1,235,074.80	3.07
			综合	5	1,821,116.79	2.71

6	99JH20110029	国寿永诚企业年金 集合计划	固定收益类	1	104,056.32	2.41
			含权益类	2	420,331.04	3.86
			综合	3	524,387.36	3.58
7	99JH20120043	国寿永富企业年金 集合计划	固定收益类	1	18,778.68	1.58
			含权益类	1	31,123.82	3.24
			综合	2	49,902.50	2.68
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	1	86,453.92	4.78
			综合	1	86,453.92	4.78
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	327,560.74	3.75
			综合	3	327,560.74	3.75
10	99JH20140048	国寿永乐企业年金 集合计划	固定收益类	2	14,870.86	2.71
			含权益类	2	73,368.69	3.83
			综合	4	88,239.55	3.64
11	合计	—	固定收益类	10	1,105,339.39	1.97
			含权益类	22	3,334,797.89	3.27

注：1. 样本为 2021 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。