

**国联安货币市场证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	国联安货币	
基金主代码	253050	
交易代码	253050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,120,003,459.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安货币 A	国联安货币 B
下属分级基金的交易代码	253050	253051
报告期末下属分级基金的份额总额	126,067,103.28 份	16,993,936,355.89 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理，定性分析与量化分析相结合，力争为投资者提供稳定的收益。
投资策略	<p>本基金采取积极的投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测，在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例，把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择，具体包括以下策略：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、利率预期策略</li> <li>2、收益率曲线策略</li> <li>3、类属配置策略</li> <li>4、现金流管理策略</li> <li>5、套利策略</li> <li>6、个券选择策略</li> </ol>

业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于债券型基金，也低于混合型基金与股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	朱萍
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtja-allianz.com">http://www.gtja-allianz.com</a>
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.	2016 年		2015 年		2014 年	
1 期 间 数 据	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B

和 指 标						
本 期 已 实 现 收 益	1,457,025.68	383,996,967.59	4,742,575.3 8	75,983,657.34	4,654,857.69	52,857,350.99
本 期 利 润	1,457,025.68	383,996,967.59	4,742,575.3 8	75,983,657.34	4,654,857.69	52,857,350.99
本 期 净 值 收 益 率	2.5553%	2.8016%	3.2153%	3.4655%	3.9306%	4.1796%
<b>3.1.</b>	<b>2016 年末</b>		<b>2015 年末</b>		<b>2014 年末</b>	
<b>2 期 末 数 据 和 指 标</b>	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B
<b>期</b>	126,067,103.	16,993,936,355.	86,418,359.	10,120,981,676.	1,007,186,795.	6,462,679,344.

末 基 金 资 产 净 值	28	89	35	89	54	73
期 末 基 金 份 额 净 值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

注：1、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3、本基金收益分配按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 国联安货币 A:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6462%	0.0022%	0.3403%	0.0000%	0.3059%	0.0022%
过去六个月	1.3008%	0.0021%	0.6805%	0.0000%	0.6203%	0.0021%
过去一年	2.5553%	0.0020%	1.3537%	0.0000%	1.2016%	0.0020%
过去三年	10.0134%	0.0052%	4.0537%	0.0000%	5.9597%	0.0052%

过去五年	18.4361%	0.0054%	6.8215%	0.0001%	11.6146%	0.0053%
自基金合同生效起至今	21.5246%	0.0054%	8.1887%	0.0002%	13.3359%	0.0052%

注：1、本基金收益分配按日结转份额；

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 2. 国联安货币 B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7064%	0.0022%	0.3403%	0.0000%	0.3661%	0.0022%
过去六个月	1.4227%	0.0021%	0.6805%	0.0000%	0.7422%	0.0021%
过去一年	2.8016%	0.0020%	1.3537%	0.0000%	1.4479%	0.0020%
过去三年	10.8098%	0.0052%	4.0537%	0.0000%	6.7561%	0.0052%
过去五年	19.8661%	0.0054%	6.8215%	0.0001%	13.0446%	0.0053%
自基金合同生效起至今	23.2699%	0.0054%	8.1887%	0.0002%	15.0812%	0.0052%

注：1、本基金收益分配按日结转份额；

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

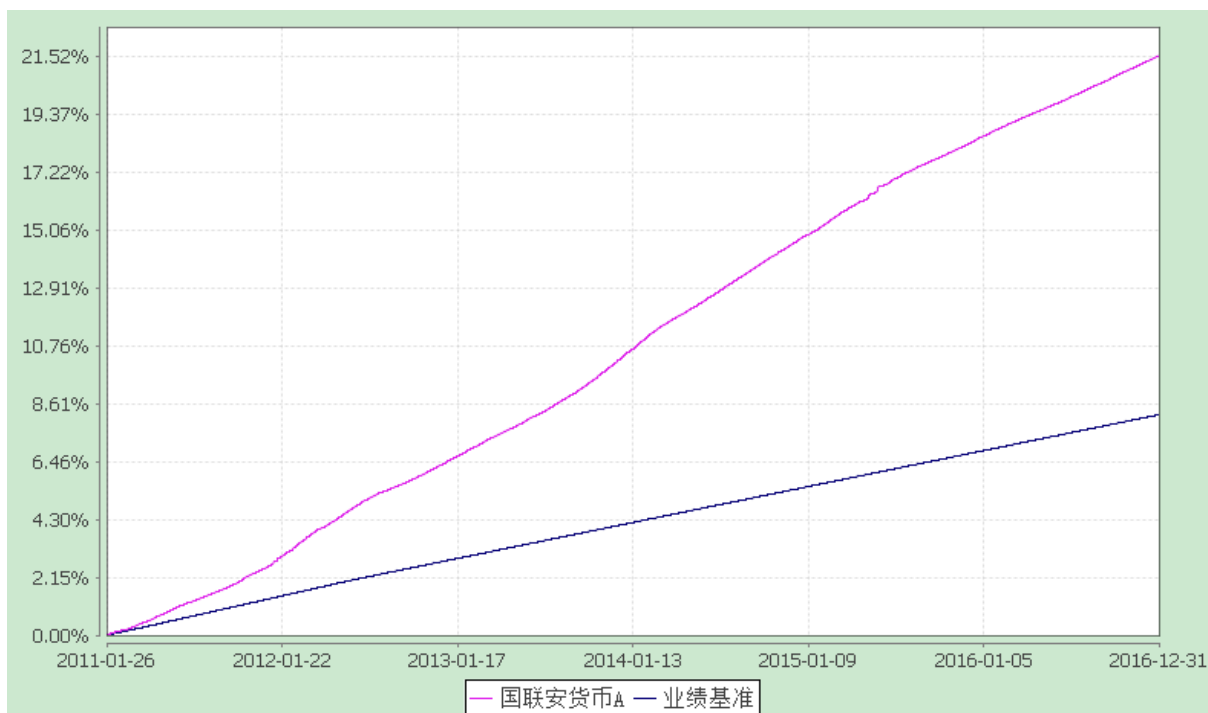
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 1 月 26 日至 2016 年 12 月 31 日)

#### 1、国联安货币 A

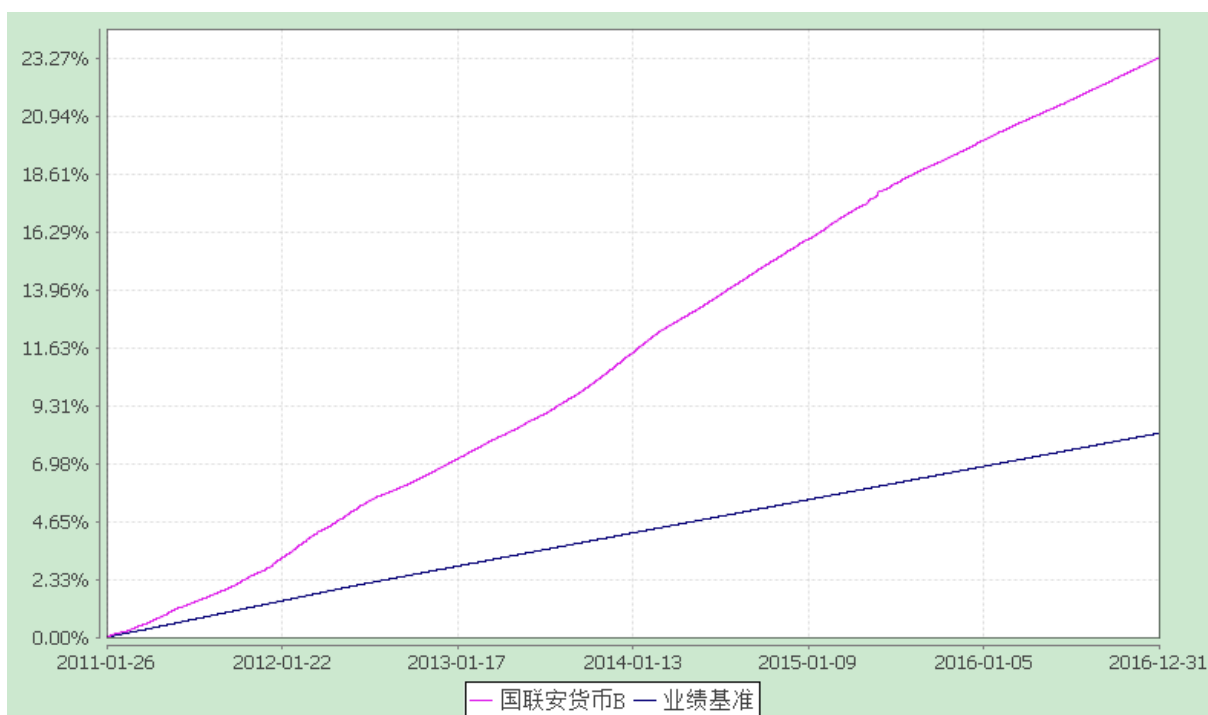


注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于 2011 年 1 月 26 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 2、国联安货币 B



注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；



2、本基金基金合同于 2011 年 1 月 26 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

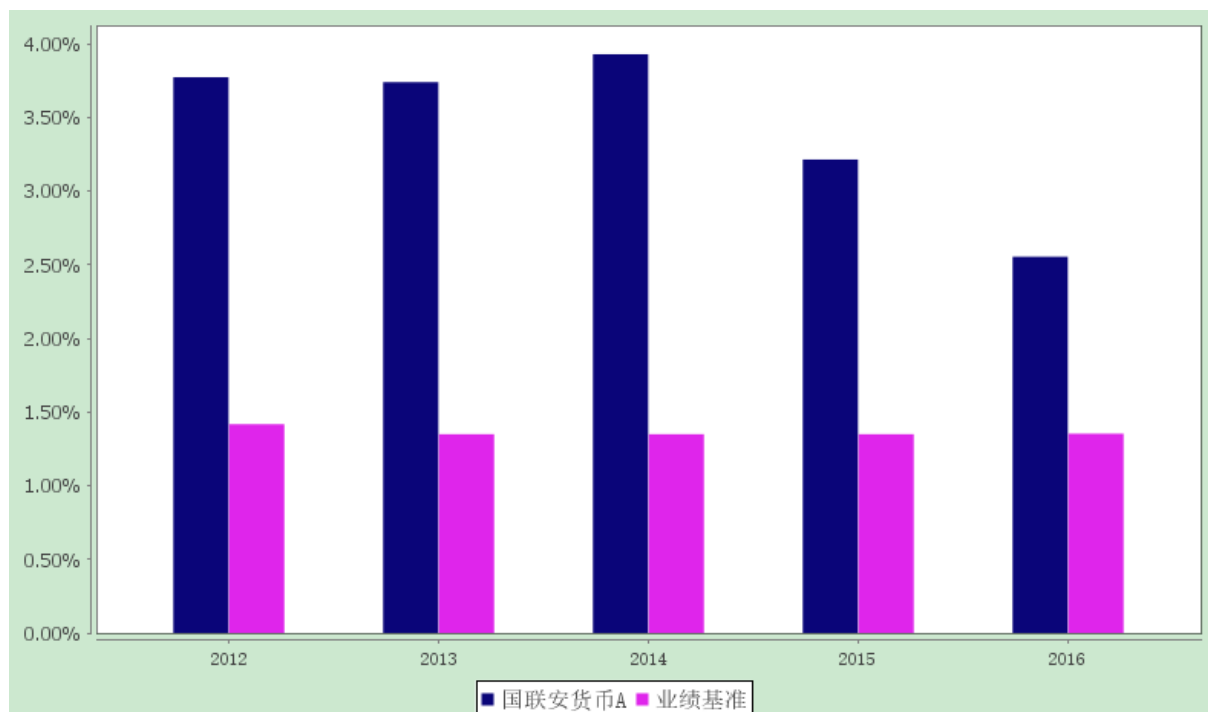
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安货币市场证券投资基金

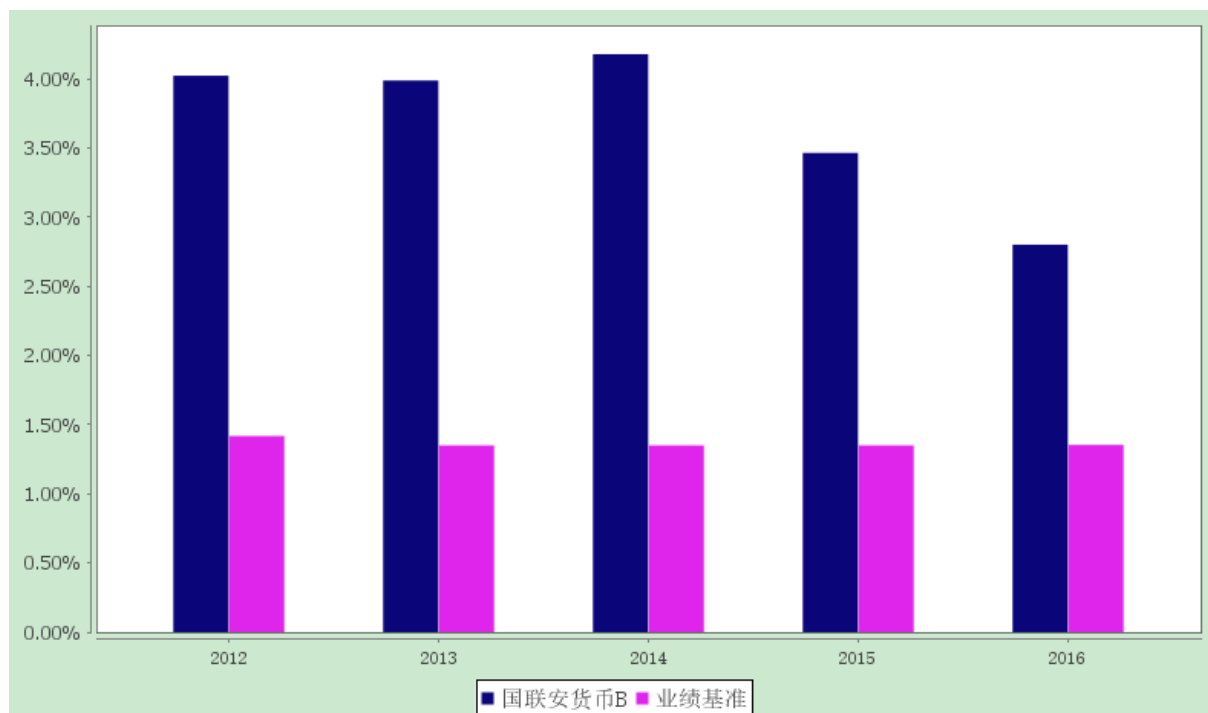
过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1、国联安货币 A



注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 2、国联安货币 B



注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

国联安货币 A:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	1,457,025.68	-	-	1,457,025.68	-
2015	4,742,575.38	-	-	4,742,575.38	-
2014	4,654,857.69	-	-	4,654,857.69	-
合计	10,854,458.75	-	-	10,854,458.75	-

国联安货币 B:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016	383,996,967.59	-	-	383,996,967.59	-

	59				
2015	75,983,657.34	-	-	75,983,657.34	-
2014	52,857,350.99	-	-	52,857,350.99	-
合计	512,837,975.92	-	-	512,837,975.92	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理三十七只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛琳	本基金基金经理、兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国	2012-07-11	2016-01-15	10 年（自 2006 年起）	薛琳女士，管理学学士。2006 年 3 月至 2006 年 12 月在上海红顶金融研究中心公司担任项目管理工作。2006 年 12 月至 2008 年 6 月在上海国利货币有限公司担任债券交易员。2008 年 6 月至 2010 年 6 月在上海长江养老保险股份有限公司担任债券交易员。自 2010 年 6 月起，加盟国联安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理职务。2012 年 7 月至 2016 年 1 月担任国联安货币市场证券投资基金基金经理。

	<p>联安通盈灵活配置混合型证券投资基金、国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金经理</p>				<p>2012 年 12 月至 2015 年 11 月兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月起兼任国联安鑫瑞混合型证券投资基金基金经理。2016 年 10 月起兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金经理。</p>
<p>侯慧娣</p>	<p>本基金基金经理、兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盛混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫利混合型证券投资基金基金经理、国联安睿</p>	<p>2015-12-25</p>	<p>-</p>	<p>9 年（自 2007 年）</p>	<p>侯慧娣女士，理学硕士。2006 年 3 月至 2006 年 7 月在国泰君安证券研究所从事国内债券市场数据分析与处理；2006 年 7 月至 2008 年 10 月在世商软件（上海）有限公司从事债券分析；2009 年 12 月至 2012 年 9 月在国信证券股份有限公司经济研究所从事债券和固定收益分析；2012 年 9 月至 2015 年 6 月在德邦基金管理有限公司固定收益部从事研究和管理的工作，期间曾担任基金经理和固定收益部副总监。2015 年 6 月加入国联安基金管理有限公司，2015 年 12 月起任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安货币市场证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起兼任国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任国联安鑫盛混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任国联安鑫利混合型证券投资基金基金经理。</p>

	利定期开放混合型证券投资基金基金经理				经理。2016 年 12 月起兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。
吕中凡	本基金基金经理助理	2015-07-04	-	5 年（自 2011 年起）	-

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限；

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易

机会。风险管理部定期对成交的银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先、价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统内的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本报告期内，公司旗下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量超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 1 次，成交较少的投资组合是指数基金，该基金根据指数公司公布的指数成份股以及权重进行被动化投资。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，执行了 95%置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验，同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析，未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年国内宏观经济基本面企稳，GDP 和工业增加值数据各季度变化不大，CPI 绝对水平仍在低位。2016 年全年来看，受去产能和供给侧改革影响，价格指标变化最大的是 PPI，从 1 月份的 -5.3%到 12 月份 5.5%，不仅从负转正，还由此引发市场在 4 季度对 CPI 传导的担忧。央行货币政策对内受国内经济基本面制约、资产价格泡沫影响以及金融部门去杠杆的调控思路影响，对外受人民币汇率贬值压力及预期影响。全年来看，前三季度货币政策稳健偏宽松，四季度货币政策基调偏向于稳健中性，央行自 8 月份以来多次强调金融“去杠杆”和“防范资产泡沫”，并辅以公开市场

逆回购“收短放长”、考虑将理财纳入 MPA 考核测算框架等措施，使资金面整体呈紧平衡状态并且期间波动上升，最终引发 2016 年 12 月份的流动性危机，2016 年全年来看货币市场利率中枢上升，债券市场收益率上行，各期限债券净价指数呈下跌趋势。

2016 年，本基金秉承现金管理工具的流动性、安全性和收益性原则，根据对货币市场趋势的判断结合组合流动性特征，主动缩短组合平均剩余期限，安排足量的流动性应付赎回。同时利用短期存款和逆回购收益率走高的机会配置适量仓位，为组合取得了较好的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安货币 A 净值收益率为 2.5553%，同期业绩比较基准增长率为 1.3537%。国联安货币 B 净值收益率为 2.8016%，同期业绩比较基准增长率为 1.3537%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，央行货币政策调控市场更加注重稳健中性并首次提到更加控制好流动性总闸门，金融去杠杆的态度和决心更加坚定，央行春节前后公开市场上调 MLF 和逆回购各期限操作利率引发市场对加息的担忧，短期存单利率和 Shibor 利率居高不下，。2016 年 4 季度以来的经济基本面企稳回升继续延续，2017 年 4 月份之前尚无法证伪数据是否能继续回升，受制于货币政策和经济基本面数据，2017 年 1 季度债券市场焦点可能是异常平坦的收益率曲线。以回购利率为代表的资金利率是否还有下行空间成为关键性因素。如果央行不引导货币市场利率下行，那么极端情况下，收益率曲线可能变得极为平坦，直到二季度最终经济和通胀回落倒逼货币政策进一步放松引导短端利率下行，重新引导收益率曲线回到正常的陡峭度。从这个角度来理解，本基金认为 2017 年债券市场的交易性机会可能会出现在二季度。

本基金将坚持作为流动性管理工具的定位，继续保持投资组合良好的流动性和适度的组合期限。未来一段时间，继续以存款和逆回购为主要投资工具，标配收益率相对较高的高资质存单。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管

银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付，并只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

本基金对本报告期内利润分配情况如下，符合本基金基金合同的相关规定。

本基金向本基金 A 级份额持有人共分配利润 1,457,025.68 元，向本基金 B 级份额持有人共分配利润 383,996,967.59 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国联安货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国联安货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金收益的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。



## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师黄小熠、张楠签字出具了毕马威华振审字第 1700457 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	3,418,217,729.63	2,915,428,840.87
结算备付金	-	338,095.24
存出保证金	-	-
交易性金融资产	10,236,481,517.02	3,404,549,828.92
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	10,236,481,517.02	3,404,549,828.92
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,553,355,148.03	3,834,592,221.87
应收证券清算款	-	-
应收利息	64,456,123.61	50,054,954.76
应收股利	-	-
应收申购款	67,038,696.40	5,161,743.94
递延所得税资产	-	-

其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>17,339,549,214.69</b>	<b>10,210,125,685.60</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	195,999,466.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	994.04	64,860.22
应付管理人报酬	3,920,852.58	1,525,168.64
应付托管费	1,188,137.14	462,172.29
应付销售服务费	134,127.14	67,965.46
应付交易费用	170,112.62	52,796.57
应交税费	243,178.08	243,178.08
应付利息	62,365.83	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	17,826,522.09	309,508.10
<b>负债合计</b>	<b>219,545,755.52</b>	<b>2,725,649.36</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	17,120,003,459.17	10,207,400,036.24
未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>17,120,003,459.17</b>	<b>10,207,400,036.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>17,339,549,214.69</b>	<b>10,210,125,685.60</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 17,120,003,459.17 份。其中国联安货币 A 份额为 126,067,103.28 份；国联安货币 B 份额为 16,993,936,355.89 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>469,942,392.82</b>	<b>93,331,085.28</b>
1.利息收入	458,088,420.03	84,927,517.03
其中：存款利息收入	128,682,065.36	37,588,934.35
债券利息收入	306,922,940.94	34,830,746.61
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	22,483,413.73	12,507,836.07
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	7,649,907.13	8,386,623.81
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,649,907.13	8,386,623.81
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,204,065.66	16,944.44
<b>减：二、费用</b>	<b>84,488,399.55</b>	<b>12,604,852.56</b>
1. 管理人报酬	46,513,892.00	8,662,764.75
2. 托管费	14,095,118.79	2,625,080.18
3. 销售服务费	1,547,690.90	643,842.89

4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	21,885,585.84	272,296.37
其中：卖出回购金融资产支出	21,885,585.84	272,296.37
6. 其他费用	446,112.02	400,868.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>385,453,993.27</b>	<b>80,726,232.72</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>385,453,993.27</b>	<b>80,726,232.72</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,207,400,036.24	-	10,207,400,036.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	385,453,993.27	385,453,993.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,912,603,422.93	-	6,912,603,422.93
其中：1.基金申购款	86,428,932,502.96	-	86,428,932,502.96
2.基金赎回款	-79,516,329,080.03	-	-79,516,329,080.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-385,453,993.27	-385,453,993.27
五、期末所有者权益（基金净值）	17,120,003,459.17	-	17,120,003,459.17

项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,469,866,140.27	-	7,469,866,140.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	80,726,232.72	80,726,232.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,737,533,895.97	-	2,737,533,895.97
其中：1.基金申购款	23,507,994,974.34	-	23,507,994,974.34
2.基金赎回款	-20,770,461,078.37	-	-20,770,461,078.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-80,726,232.72	-80,726,232.72
五、期末所有者权益（基金净值）	10,207,400,036.24	-	10,207,400,036.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国联安货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准国联安货币市场证券投资基金募集的批复》（证监许可 [2010]1587 号文）批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安货币市场证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2011 年 1 月 26 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,845,589,169.30 份基金份额。本基金的基金管理人

为国联安基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》和《国联安货币市场证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、同业存单，期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购，期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”），中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生过会计差错。

### 7.4.6 税项

#### (1) 主要税项说明

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下简称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资产管理产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资产管理产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资产管理产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d)对基金取得的债券的利息收入，发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(e)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### (2) 应交税费

债券利息收入所得税	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
	243,178.08	243,178.08

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司(“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司
国联安基金浦发银行国联安-鑫享-悦达醴泉 1 号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-狄普君桐 1 号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-盛世源量化中性阿尔法 8 号资管计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-盛世源量化中性阿尔法 5 号资管计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-华融-定增 5 号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安海天稳健 1 号特定客户资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

本报告期内与上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

##### 7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元



关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	570,000,000.00	100.00%	4,426,400,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内与上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	46,513,892.00	8,662,764.75
其中：支付销售机构的客户维护费	238,243.48	396,197.85

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.33% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	14,095,118.79	2,625,080.18
----------------	---------------	--------------

注：支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安货币 A	国联安货币 B	合计
浦发银行	8,894.37	5.39	8,899.76
国泰君安	4,712.00	1,464.40	6,176.40
国联安基金管理有限公司	46,088.73	1,368,680.44	1,414,769.17
合计	59,695.10	1,370,150.23	1,429,845.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安货币A	国联安货币B	合计
浦发银行	12,783.25	-	12,783.25
国泰君安	4,611.75	2,147.60	6,759.35
国联安基金管理有限公司	123,530.11	230,812.57	354,342.68
合计	140,925.11	232,960.17	373,885.28

注：1、支付基金销售机构的国联安货币 A 基金份额的销售服务费按前一日国联安货币 A 基金资产净值 0.25%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日国联安货币 A 基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2、支付基金销售机构的国联安货币 B 基金份额的销售服务费按前一日国联安货币 B 基金资产净值 0.01%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日国联安货币 B 基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

3、对于由国联安货币 B 降级为国联安货币 A 的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级日后的下一个工作日起适用国联安货币 A 基金份额持有人的费率；对于由国联安货币 A 升级为国联安货币 B 的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其升级日后的下一个工作日起享受 B 级基金份额持有人的费率。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安	-	-	504,750,00 0.00	516,713.6 9	347,000,000.0 0	61,692.68
浦发银行	-	-	-	-	1,395,800,000. 00	158,907.2 1
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安	-	10,558,886. 85	116,700,00 0.00	128,538.4 8	-	-

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B
期初持有的基金份额	-	372,478,033.08	-	-

期间申购/买入总份 额	-	150,000,000.00	-	420,000,000.00
期间因拆分变动份 额	-	9,576,904.68	-	2,478,033.08
减：期间赎回/卖出 总份额	-	155,000,000.00	-	50,000,000.00
期末持有的基金份 额	-	377,054,937.76	-	372,478,033.08
期末持有的基金份 额占基金总份额比 例	-	2.22%	-	3.68%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国联安货币 A

份额单位：份

关联方名称	国联安货币A本期末 2016年12月31日		国联安货币A上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
国联安海天稳健 1号特定客户资产 管理计划	362,772.46	0.29%	-	-
国联安基金浦发银 行国联安—鑫享— 悦达醴泉1号资产 管理计划	-	-	937,296.62	1.08%

国联安货币 B

份额单位：份

关联方名称	国联安货币B本期末 2016年12月31日		国联安货币B上年度末 2015年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	占基金总份额的比例	基金份额	占基金总份额的比例
中德安联	89,734,411.33	0.53%	-	-
国泰君安	197,459,823.47	1.16%	-	-
国联安-华融-定增5号资产管理计划	7,619,527.93	0.04%	-	-
国联安基金浦发银行国联安-狄普君桐1号资产管理计划	-	-	40,000,000.00	0.40%
国联安基金浦发银行国联安-盛世源量化中性阿尔法8号资管计划	-	-	29,947,818.40	0.30%
国联安基金浦发银行国联安-盛世源量化中性阿尔法5号资管计划	-	-	37,391,705.48	0.37%

#### 7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	2,718,217,729.63	18,102,997.39	15,428,840.87	4,122,062.75

注：本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 0 元。于 2015 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 338,095.24 元

#### 7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内与上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本报告期内与上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.9期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发和增发而流通受限的证券。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 195,999,466.00 元，是以如下债券作为质押

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
140208	14 国开 08	2017-01-05	100.60	1,000,000.00	100,600,000.00
111694629	16 贵州银行 CD012	2017-01-05	97.94	1,000,000.00	97,940,000.00
合计				2,000,000.00	198,540,000.00

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比 例（%）
1	固定收益投资	10,236,481,517.02	59.04
	其中：债券	10,236,481,517.02	59.04
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	3,553,355,148.03	20.49
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,418,217,729.63	19.71
4	其他各项资产	131,494,820.01	0.76
5	合计	17,339,549,214.69	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.80	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	195,999,466.00	1.14
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2016-06-30	20.02	2016年6月30日国联安货币基金正回购资金余额占基金资产净值的比例为20.02%，超过合同规定的20%，主要系连续大额赎回导致的被动超标，根据合同规定在5个交易日内进行调整。	5个交易日内
2	2016-07-12	20.05	7月12日货币基金遭遇大额赎回，正回购投资比例系净值波动导致的被动超标，已于7月13日调整至20%以下。	5个交易日内

3	2016-10-13	20.07	被动超标	2 个交易日内调整完毕
---	------------	-------	------	-------------

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	29.21	1.14
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	23.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	21.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.52	1.14

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内，本货币市场基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元



序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	601,310,107.97	3.51
	其中：政策性金融债	601,310,107.97	3.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,219,968,463.16	12.97
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,415,202,945.89	43.31
8	其他	-	-
9	合计	10,236,481,517.02	59.79
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111698339	16 云南红塔银行 CD002	5,000,000	495,705,687.06	2.90
2	111693657	16 潍坊 CD011	4,000,000	398,275,984.70	2.33
3	140201	14 国开 01	3,700,000	370,431,847.69	2.16
4	111698776	16 杭州联合银行 CD188	3,000,000	299,427,225.83	1.75
5	111698263	16 中德住房储蓄银行 CD015	3,000,000	297,472,863.12	1.74
6	111698545	16 宁波银行 CD214	3,000,000	297,198,381.67	1.74
7	111695948	16 赣州银行 CD016	3,000,000	297,040,371.23	1.74
8	111681054	16 徽商银行 CD118	3,000,000	290,758,118.65	1.70
9	111697946	16 中德住房储蓄银行 CD014	2,600,000	258,140,108.88	1.51
10	111680074	16 上饶银行 CD037	2,500,000	248,958,699.83	1.45

**8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离**

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.14%
报告期内偏离度的最低值	-0.2499%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.08%

**报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明**

本报告期内本货币市场基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本报告期内本货币市场基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

**8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**8.9 投资组合报告附注**

**8.9.1 基金计价方法说明**

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

**8.9.2 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，以及经核实托管人提供的信息，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

**8.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	64,456,123.61
4	应收申购款	67,038,696.40
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	131,494,820.01
---	----	----------------

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国联安货币 A	2,031	62,071.44	23,738,435.55	18.83%	102,328,667.73	81.17%
国联安货币 B	122	139,294,560.29	16,625,167,936.97	97.83%	368,768,418.92	2.17%
合计	2,153	7,951,696.92	16,648,906,372.52	97.25%	471,097,086.65	2.75%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安货币 A	1,000,763.24	0.79%
	国联安货币 B	-	-
	合计	1,000,763.24	0.01%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安货币 A	国联安货币 B
基金合同生效日（2011 年 1 月 26 日）	1,418,735,986.38	1,427,051,241.81

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	86,418,359.35	10,120,981,676.89
本报告期基金总申购份额	436,674,353.22	85,992,258,149.74
减：本报告期基金总赎回份额	397,025,609.29	79,119,303,470.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,067,103.28	16,993,936,355.89

注：

总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额；总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2016 年 6 月 25 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起刘轶先生担任我司督察长一职。公司总经理谭晓雨女士不再代为履行督察长职责。

2. 2016 年 1 月 15 日，基金管理人发布《国联安货币市场证券投资基金基金经理变更公告》。薛琳女士不再担任本基金的基金经理。

3. 2016 年 1 月起，基金托管人进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金本报告期末支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 7 万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续 6 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、 专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。
- F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	570,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

国联安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日