

国寿安保尊利增强回报债券型
证券投资基金
2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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 5 月 26 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	45
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	45
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
8.11 投资组合报告附注	46
§9 基金份额持有人信息.....	46
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§10 开放式基金份额变动.....	47
§11 重大事件揭示.....	48
11.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
11.4 基金投资策略的改变	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
11.8 其他重大事件	49
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误!未定义书签。
§13 备查文件目录.....	51
13.1 备查文件目录	51
13.2 存放地点	51
13.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金	
基金简称	国寿安保尊利增强回报债券	
基金主代码	002720	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 5 月 26 日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	188,850,022.87 份	
基金合同存续期间	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保尊利增强回报债券 A	国寿安保尊利增强回报债券 C
下属分级基金的交易代码:	002720	002721
报告期末下属分级基金的份额总额	173,625,364.77 份	15,224,658.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过主要投资于债券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具，并适时配置权益资产，以及通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，通过主动管理投资策略，在主要配置债券资产的前提下，适当配置权益类资产，达到增强收益的目的。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债综合（全价）指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种。从预期风险收益方面看，本基金的预期风险收益水平相应会高于货币市场基金，低于混合型基金、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	国寿安保基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95588
传真	010-50850776	010-66105798
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28	北京市西城区复兴门内大街 55

	号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	号
邮政编码	100033	100140
法定代表人	王军辉	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

§ 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

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	国寿安保尊利增强回报债券 A	国寿安保尊利增强回报债券 C
本期已实现收益	2,053,329.05	637,497.43
本期利润	730,288.34	640,450.14
加权平均基金份额本期利润	0.0032	0.0107
本期加权平均净值利润率	0.32%	1.06%
本期基金份额净值增长率	0.10%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配利润	238,460.85	633.58
期末可供分配基金份额利润	0.0014	0.0000
期末基金资产净值	173,863,825.62	15,225,291.68
期末基金份额净值	1.001	1.000
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	
基金份额累计净值增长率	0.10%	0.00%

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保尊利增强回报债券 A

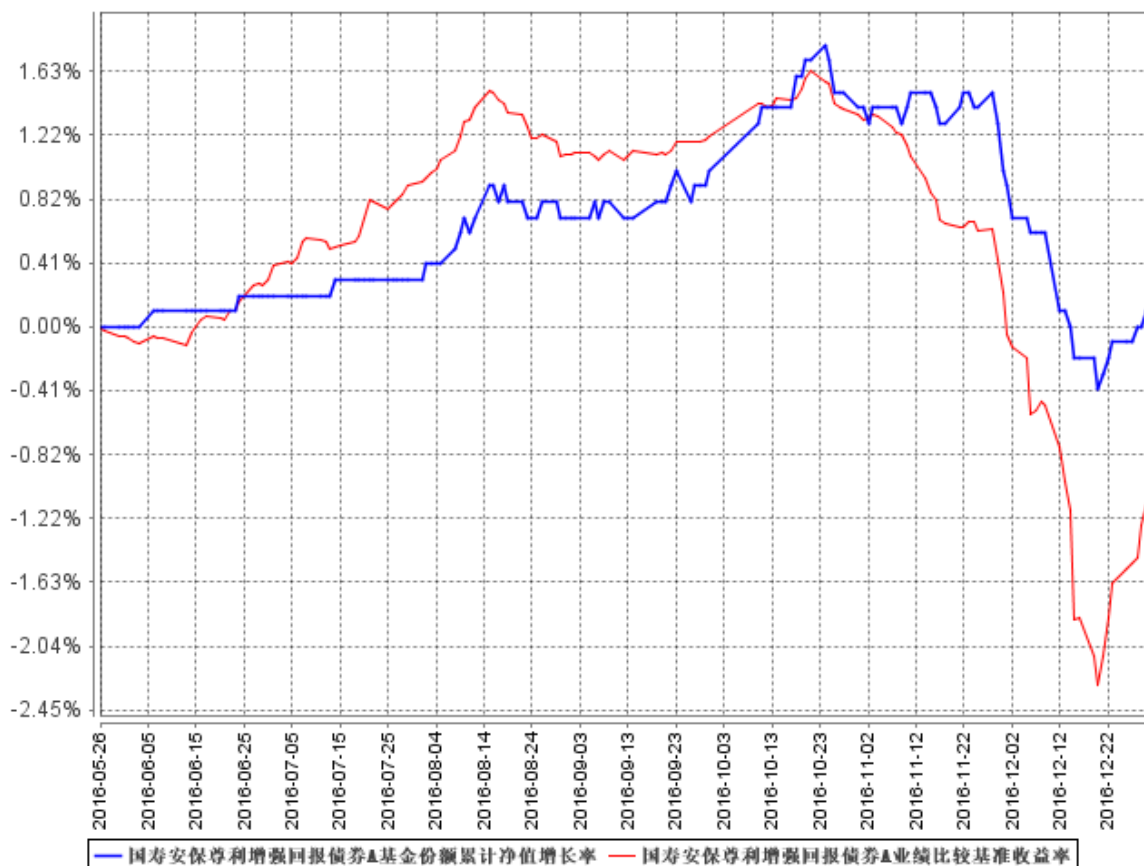
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.89%	0.12%	-2.32%	0.15%	1.43%	-0.03%
过去六个月	-0.10%	0.10%	-1.43%	0.11%	1.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.09%	-1.13%	0.10%	1.23%	-0.01%

国寿安保尊利增强回报债券 C

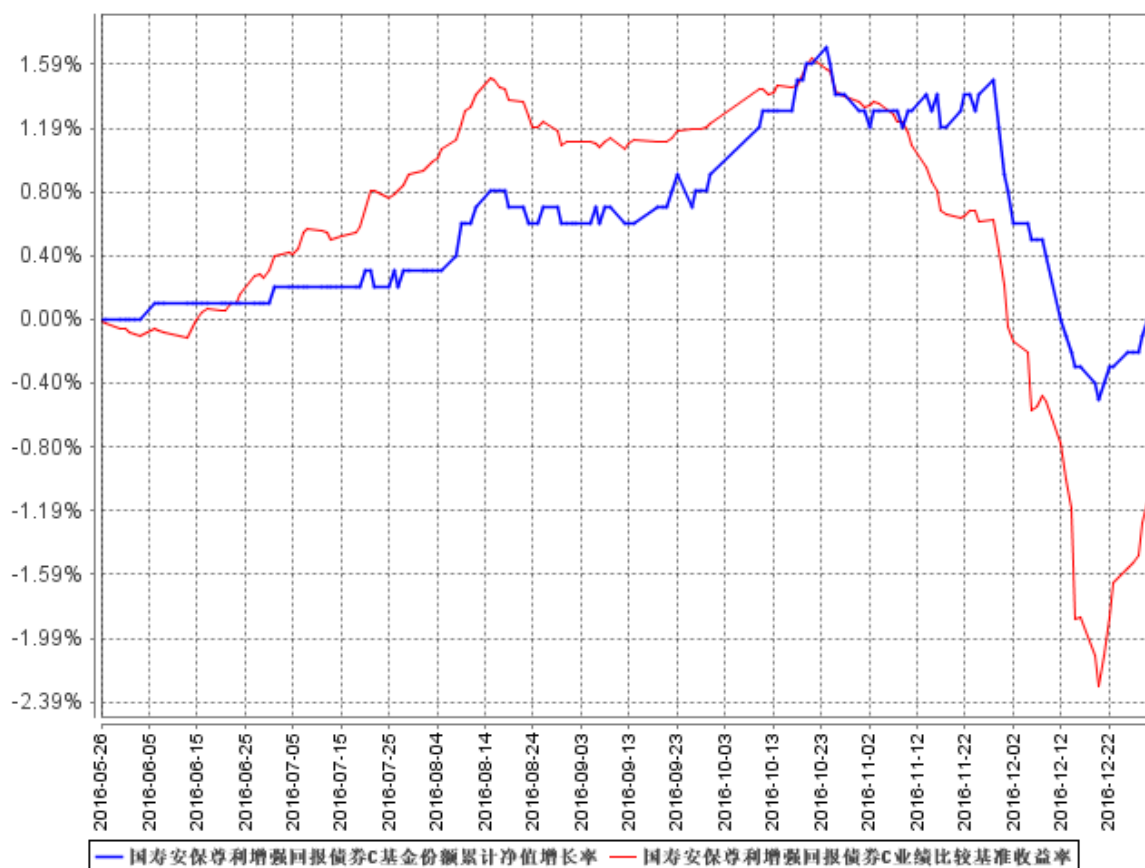
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.89%	0.12%	-2.32%	0.15%	1.43%	-0.03%
过去六个月	-0.10%	0.10%	-1.43%	0.11%	1.33%	-0.01%
自基金合同生效起至今	0.00%	0.09%	-1.13%	0.10%	1.13%	-0.01%

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

国寿安保尊利增强回报债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



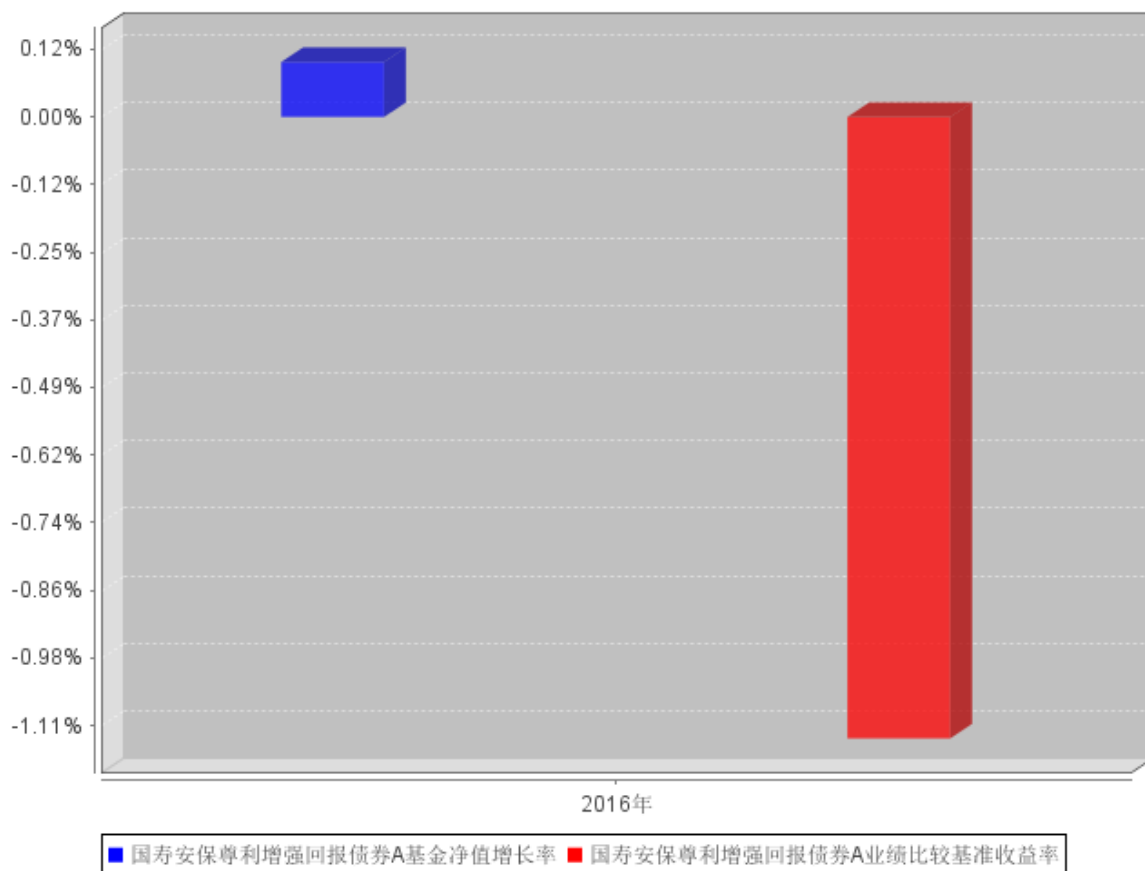
国寿安保尊利增强回报债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



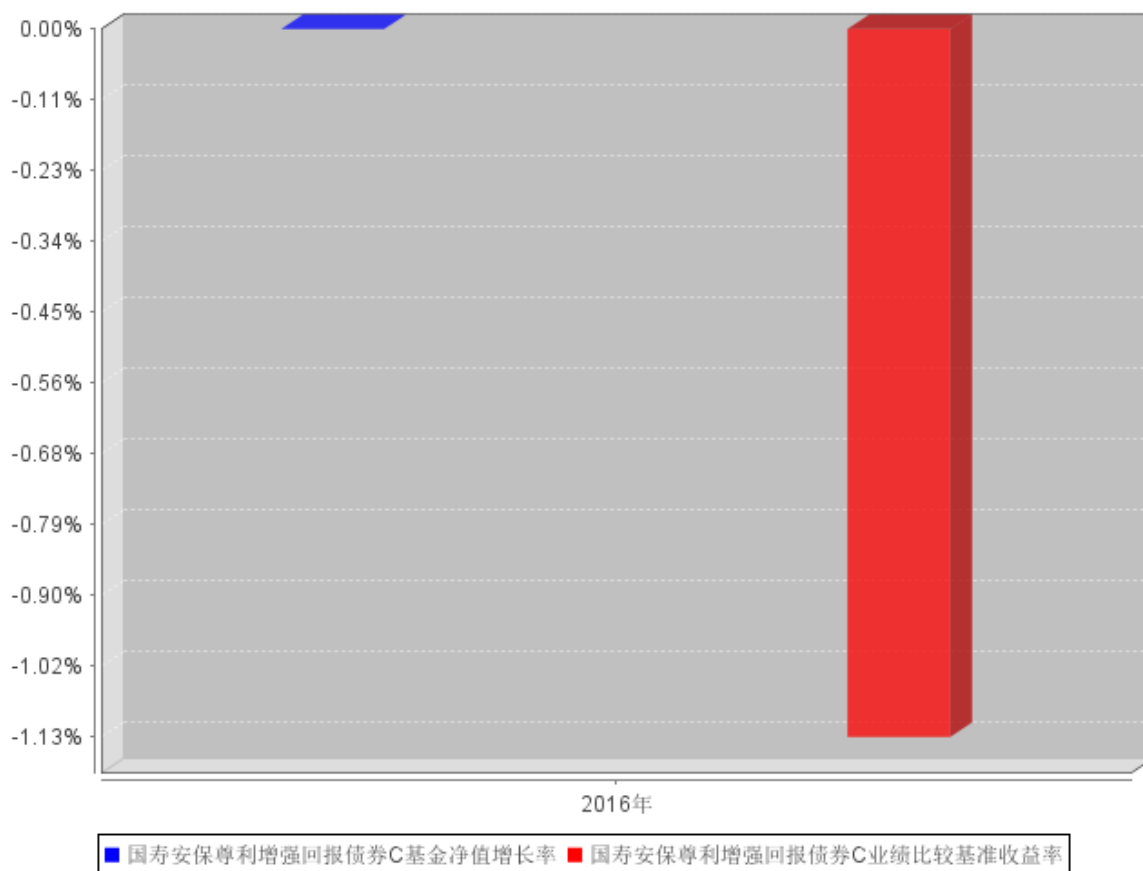
注：本基金基金合同生效日为 2016 年 5 月 26 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保尊利增强回报债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



国寿安保尊利增强回报债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自 2016 年 5 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§ 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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准,于2013年10月29日设立,公司注册资本5.88亿元人民币,公司股东为中国人寿资产管理有限公司,其持有股份85.03%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(澳大利亚安保资本投资有限公司),其持有股份14.97%。

截至 2016 年 12 月 31 日,公司共管理 25 只开放式基金和部分特定资产管理计划,公司管理资产总规模为 1151.37 亿元,其中公募基金管理规模 785.16 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
董瑞倩	投资管理部 总经理、基金经理	2016 年 5 月 26 日	-	19 年	董瑞倩女士，硕士。曾任工银瑞信基金管理有限公司专户投资部基金经理，中银国际证券有限责任公司定息收益部副总经理、执行总经理；现任国寿安保基金管理有限公司投资管理部总经理，国寿安保尊享债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保稳定回报混合型证券投资基金、国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保稳健回报混合型证券投资基金、国寿安保保本混合型证券投资基金及国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金经理。
李一鸣	基金经理	2016 年 5 月 26 日	-	8 年	曾任中银国际定息收益部研究员、中信证券固定收益部研究员，2013 年 11 月加入国寿安保基金任基金经理助理，现任国寿安保尊益信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、

					国寿安保安康纯债债券型证券投资基金及国寿安保安享纯债债券型证券投资基金基金经理。
李捷	基金经理	2016 年 6 月 29 日	-	9 年	李捷先生，硕士。曾任德勤华永会计师事务所高级审计师，中国国际金融有限公司分析员，财富里昂证券有限责任公司投资分析师。2013 年 12 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任国寿安保保本混合型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金及国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露

露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在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的 5% 的情形。

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 年中国债券市场波动剧烈，机构配置行为和流动性因素对市场的影响力日益加深，而经济基本面对利率的驱动则显得较为迟缓。前三季度在银行委外、同业理财等配置力量的推动下，债券行情呈现出资金推动的特征，债券利率持续回落逼近 2008 年的历史低点，信用利差逐渐压缩至历史低位，期间仅在 4 月份因机构集中赎回出现短期回调。四季度开始，工业品价格上涨和海外再通胀预期对债市形成利空，同时监管部门对降杠杆、防风险的态度更加明朗，金融机构融资成本抬升，债券市场出现机构赎回、下跌、进一步赎回的负循环，债券收益率大幅上行。

投资运作方面，本基金在报告期内以中高等级、中短久期信用债为主要配置品种，并在有效控制回撤的基础上参与 A 股市场投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类基金份额净值为 1.001 元，累计份额净值为 1.001 元；C 类基金份额净值为 1.000 元，累计份额净值为 1.000 元。报告期内 A 类基金份额净值增长率为 0.10%，C 类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩基准涨幅为 -1.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年中国经济的内生增长动力并不强劲，全年来看经济基本面对债券市场仍有一定支撑。从长周期来看，劳动力、资源等要素成本的抬升使得中国经济潜在增长率

逐渐回落，经济增长越来越受到人口老龄化及资源环境的制约。中期而言，产能过剩和与之相伴的企业部门的高杠杆问题尚未根本改善。短期内，虽然中国经济在前期基建拉动和出口回暖的支撑下表现平稳，但房地产市场在严厉的调控政策下存在放缓的风险，工业生产端也将逐渐感受到需求走弱的压力，通胀风险预计总体可控。

政策面来看，中央经济工作会议强调货币政策要保持稳健中性，既要维护流动性基本稳定、确保不发生系统性金融风险，又要着力防控资产泡沫。预计央行将继续使用逆回购、SLF、MLF 等工具进行调控并传递价格信号，准备金率调整的概率较小。

市场策略方面，长期来看经济基本面仍然对债市有支撑，在市场调整风险释放后，2017 年债券市场存在一定的交易性机会，有理由对债市保持谨慎乐观态度。本基金未来将采取更加灵活的投资策略，在 2017 年前期优化组合资产配置，减持部分流动性较差的债券，提高组合的流动性，并且密切关注防守反击的投资机会；权益投资将延续稳健风格。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修

订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场交易和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 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，本基金托管人在对国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对国寿安保基金管理有限公司编制和披露的国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2017)审字第 61090605_A21 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年 5 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国寿安保基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	辜 虹	范新紫
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	

会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,400,159.23
结算备付金		181,185.34
存出保证金		16,306.90
交易性金融资产	7.4.7.2	180,055,584.00
其中：股票投资		6,887,508.60
基金投资		-
债券投资		173,168,075.40
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,500,000.00
应收证券清算款		109,530.63
应收利息	7.4.7.5	3,241,740.72
应收股利		-
应收申购款		9.99
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		189,504,516.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		198.04
应付管理人报酬		134,682.08
应付托管费		33,670.53

应付销售服务费		4,838.54
应付交易费用	7.4.7.7	52,008.82
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	190,001.50
负债合计		415,399.51
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	188,850,022.87
未分配利润	7.4.7.10	239,094.43
所有者权益合计		189,089,117.30
负债和所有者权益总计		189,504,516.81

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，国寿安保尊利增强回报 A 类基金份额净值人民币 1.001 元，国寿安保尊利增强回报 C 类基金份额净值人民币 1.000 元，基金份额总额 188,850,022.87 份，其中中国寿安保尊利增强回报 A 类基金份额总额 173,625,364.77 份，国寿安保尊利增强回报 C 类基金份额总额 15,224,658.10 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		4,048,815.46
1.利息收入		6,030,670.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,649,909.68
债券利息收入		4,294,735.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		86,025.37
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-715,663.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	918,300.14
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,633,963.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,320,088.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	53,896.41
减：二、费用		2,678,076.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,396,934.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	349,233.47
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	126,870.96
4. 交易费用	7.4.7.19	127,388.71
5. 利息支出		403,458.48
其中：卖出回购金融资产支出		403,458.48
6. 其他费用	7.4.7.20	274,191.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,370,738.48
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,370,738.48

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金

本报告期：2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年5月26日(基金合同生效日)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）	402,901,631.60	-	402,901,631.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,370,738.48	1,370,738.48
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）	-214,051,608.73	-1,131,644.05	-215,183,252.78
其中：1. 基金申购款	360,846.70	2,639.61	363,486.31
2. 基金赎回款	-214,412,455.43	-1,134,283.66	-215,546,739.09
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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	188,850,022.87	239,094.43	189,089,117.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 左季庆	_____ 左季庆	_____ 韩占锋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2016]379号文《关于准予国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2016年5月3日至2016年5月23日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2016)验字第61090605_A03号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年5月26日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资人认（申）购、赎回时，收取认（申）购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。首次募集规模为272,526,466.19份A类基金份额，130,375,165.41份C类基金份额。国寿安保尊利增强回报A类及C类收到的实收基金合计人民币402,901,631.60元，分别折合成A类和C类基金份额，合计折合402,901,631.60份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“工商银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类资产及债券等固定收益类金融工具以及法律法规或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相关规定）。

本基金投资的具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、债券回购和债券类资产，其中债券类资产包括国内依法发行上市的国家债券、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业

债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、证券公司短期公司债券、同业存单、可转让存单，以及法律法规或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）。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 5 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金的报告期间为 2016 年 5 月 26 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明

外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融

资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在

是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其

成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的该类别基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行

再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(4) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金于本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入, 继续免征营业税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定, 经国务院批准, 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试点, 金融业纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(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、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定, 2017 年 7 月 1 日(含) 以后, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 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, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(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、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的

通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,400,159.23
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,400,159.23

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	7,353,596.37	6,887,508.60	-466,087.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	18,116,572.04	17,725,575.40
	银行间市场	155,905,503.59	155,442,500.00
	合计	174,022,075.63	173,168,075.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	181,375,672.00	180,055,584.00	-1,320,088.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	2,500,000.00	-
合计	2,500,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,262.58
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	89.65
应收债券利息	3,238,557.54
应收买入返售证券利息	1,822.92
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.03
合计	3,241,740.72

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	40,769.33
银行间市场应付交易费用	11,239.49
合计	52,008.82

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.50
预提费用	190,000.00
合计	190,001.50

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保尊利增强回报债券 A		
项目	本期 2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	272,526,466.19	272,526,466.19
本期申购	82,604.76	82,604.76
本期赎回(以“-”号填列)	-98,983,706.18	-98,983,706.18
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	173,625,364.77	173,625,364.77

金额单位：人民币元

国寿安保尊利增强回报债券 C		
项目	本期 2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	130,375,165.41	130,375,165.41
本期申购	278,241.94	278,241.94
本期赎回（以“-”号填列）	-115,428,749.25	-115,428,749.25
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,224,658.10	15,224,658.10

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保尊利增强回报债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,053,329.05	-1,323,040.71	730,288.34
本期基金份额交易产生的变动数	-814,363.62	322,536.13	-491,827.49
其中：基金申购款	857.78	173.77	1,031.55
基金赎回款	-815,221.40	322,362.36	-492,859.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,238,965.43	-1,000,504.58	238,460.85

单位：人民币元

国寿安保尊利增强回报债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	637,497.43	2,952.71	640,450.14
本期基金份额交易产生的变动数	-549,225.69	-90,590.87	-639,816.56
其中：基金申购款	1,421.37	186.69	1,608.06
基金赎回款	-550,647.06	-90,777.56	-641,424.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,271.74	-87,638.16	633.58

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	51,498.25
定期存款利息收入	1,596,872.23
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,477.55
其他	61.65
合计	1,649,909.68

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	43,353,722.68
减：卖出股票成本总额	42,435,422.54
买卖股票差价收入	918,300.14

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,633,963.61
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-1,633,963.61

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	404,239,465.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	400,844,751.31
减：应收利息总额	5,028,677.95
买卖债券差价收入	-1,633,963.61

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,320,088.00
——股票投资	-466,087.77
——债券投资	-854,000.23
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,320,088.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	53,896.41
合计	53,896.41

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	119,726.21
银行间市场交易费用	7,662.50
合计	127,388.71

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年5月26日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	70,000.00
信息披露费	180,000.00
中债登账户维护费	7,000.00
银行费用	13,591.23
上清所账户维护费	3,000.00
其他	600.00

合计	274,191.23
----	------------

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司（简称“工商银行”）	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	国寿资产的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	集团公司控制的公司
中国人寿财产保险股份有限公司（简称“国寿财险”）	集团公司控制的公司
中国人寿电子商务有限公司	集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司	基金管理人的子公司
国寿（天津）养老养生投资有限公司	集团公司控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,396,934.13
其中:支付销售机构的客户维护费	199,271.95

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	349,233.47

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.1.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
工商银行	96,471.42
国寿安保	28,733.95
合计	125,205.37

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。基金销售服务费每日计提,按月支付。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.35%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.35\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.3.2 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

份额单位：份

国寿安保尊利增强回报债券 A		
关联方名称	本期末 2016 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
中国人寿	80,001,600.00	46.08%

7.4.10.4 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 2016 年 5 月 26 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	3,400,159.23	51,498.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
002400	省广股份	2016年11月28日	公告重大事项	13.79	-	-	80,000	1,139,870.00	1,103,200.00	-
002440	闰土股份	2016年10月21日	公告重大事项	16.34	2017年1月12日	15.22	40,000	632,800.00	653,600.00	-
300450	先导智能	2016年11月15日	公告重大事项	33.99	2017年2月8日	33.00	10,000	349,000.00	339,900.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,400,159.23	-	-	-	3,400,159.23
结算备付金	181,185.34	-	-	-	181,185.34
存出保证金	16,306.90	-	-	-	16,306.90
交易性金融资产	108,197,871.20	45,538,699.20	19,431,505.00	6,887,508.60	180,055,584.00
买入返售金融资产	2,500,000.00	-	-	-	2,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	109,530.63	109,530.63
应收利息	-	-	-	3,241,740.72	3,241,740.72
应收申购款	-	-	-	9.99	9.99
资产总计	114,295,522.67	45,538,699.20	19,431,505.00	10,238,789.94	189,504,516.81
负债					

应付赎回款	-	-	-	198.04	198.04
应付管理人报酬	-	-	-	134,682.08	134,682.08
应付托管费	-	-	-	33,670.53	33,670.53
应付销售服务费	-	-	-	4,838.54	4,838.54
应付交易费用	-	-	-	52,008.82	52,008.82
其他负债	-	-	-	190,001.50	190,001.50
负债总计	-	-	-	415,399.51	415,399.51
利率敏感度缺口	114,295,522.67	45,538,699.20	19,431,505.00	9,823,390.43	189,089,117.30

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2016 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-741,530.17
	-25 个基点	741,530.17

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无重大价格风险。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外

汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

银行存款、买入返售金融资产等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 5,842,012.80 元，属于第二层次的余额为人民币 174,213,571.20 元，本报告期末无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期以公允价值计量的金融工具持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在第一层次和第二层次之间均无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具均未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	权益投资	6,887,508.60	3.63
	其中：股票	6,887,508.60	3.63
2	固定收益投资	173,168,075.40	91.38
	其中：债券	173,168,075.40	91.38
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	2,500,000.00	1.32
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,581,344.57	1.89
7	其他各项资产	3,367,588.24	1.78
8	合计	189,504,516.81	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	217,200.00	0.11
C	制造业	4,504,508.60	2.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	551,100.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	511,500.00	0.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,103,200.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,887,508.60	3.64

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002400	省广股份	80,000	1,103,200.00	0.58
2	600418	江淮汽车	60,000	693,600.00	0.37
3	300263	隆华节能	90,000	663,300.00	0.35
4	002440	闰土股份	40,000	653,600.00	0.35
5	601021	春秋航空	15,000	551,100.00	0.29
6	600328	兰太实业	40,000	524,800.00	0.28
7	000783	长江证券	50,000	511,500.00	0.27
8	600586	金晶科技	80,000	370,400.00	0.20
9	300450	先导智能	10,000	339,900.00	0.18
10	600978	宜华生活	30,000	319,500.00	0.17
11	000521	美菱电器	40,030	277,007.60	0.15
12	600894	广日股份	20,000	273,400.00	0.14
13	600508	上海能源	20,000	217,200.00	0.11
14	002690	美亚光电	10,000	211,600.00	0.11
15	300408	三环集团	10,000	158,800.00	0.08
16	002705	新宝股份	1,100	18,601.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300011	鼎汉技术	2,382,700.00	1.26
2	002690	美亚光电	1,933,100.00	1.02
3	000521	美菱电器	1,637,019.30	0.87
4	600835	上海机电	1,634,509.00	0.86
5	002038	双鹭药业	1,515,795.50	0.80
6	300351	永贵电器	1,442,212.00	0.76
7	600418	江淮汽车	1,424,755.00	0.75
8	002073	软控股份	1,318,200.00	0.70
9	002644	佛慈制药	1,156,631.00	0.61
10	002400	省广股份	1,139,870.00	0.60
11	601126	四方股份	1,086,000.00	0.57
12	002465	海格通信	1,010,400.00	0.53
13	300369	绿盟科技	937,678.00	0.50
14	601311	骆驼股份	932,643.00	0.49

15	601186	中国铁建	918,000.00	0.49
16	600708	光明地产	841,900.00	0.45
17	601021	春秋航空	837,360.00	0.44
18	600348	阳泉煤业	832,800.00	0.44
19	600050	中国联通	822,000.00	0.43
20	600328	兰太实业	801,200.00	0.42

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300011	鼎汉技术	2,405,118.00	1.27
2	002690	美亚光电	1,679,533.00	0.89
3	600835	上海机电	1,667,830.28	0.88
4	002073	软控股份	1,416,512.00	0.75
5	300351	永贵电器	1,361,104.00	0.72
6	002038	双鹭药业	1,329,694.00	0.70
7	000521	美菱电器	1,312,641.00	0.69
8	601186	中国铁建	1,200,147.72	0.63
9	601126	四方股份	1,092,481.32	0.58
10	002644	佛慈制药	1,015,900.00	0.54
11	300369	绿盟科技	1,012,284.00	0.54
12	600050	中国联通	940,933.34	0.50
13	002465	海格通信	929,224.20	0.49
14	600708	光明地产	918,000.00	0.49
15	600348	阳泉煤业	912,667.73	0.48
16	601311	骆驼股份	856,972.50	0.45
17	000860	顺鑫农业	724,622.00	0.38
18	002184	海得控制	718,800.00	0.38
19	002004	华邦健康	685,188.00	0.36
20	600038	中直股份	682,888.24	0.36

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	49,789,018.91
卖出股票收入（成交）总额	43,353,722.68

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	34,190,500.00	18.08
	其中：政策性金融债	34,190,500.00	18.08
4	企业债券	16,674,371.20	8.82
5	企业短期融资券	80,122,000.00	42.37
6	中期票据	41,130,000.00	21.75
7	可转债（可交换债）	1,051,204.20	0.56
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	173,168,075.40	91.58

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	160210	16 国开 10	200,000	19,234,000.00	10.17
2	120223	12 国开 23	150,000	14,956,500.00	7.91
3	101458012	14 龙净环保 MTN001	100,000	10,741,000.00	5.68
4	101464021	14 赣建工 MTN001	100,000	10,205,000.00	5.40
5	011697038	16 一心堂 SCP001	100,000	10,112,000.00	5.35

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金本报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

8.11.2 基金投资前十名股票未超出基金合同规定的股票库。

8.11.3 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	16,306.90
2	应收证券清算款	109,530.63
3	应收股利	-
4	应收利息	3,241,740.72
5	应收申购款	9.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,367,588.24

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002400	省广股份	1,103,200.00	0.58	公告重大事项
2	002440	闰土股份	653,600.00	0.35	公告重大事项
3	300450	先导智能	339,900.00	0.18	公告重大事项

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国寿安保尊利增强回报债券A	138	1,258,154.82	169,006,800.00	97.34%	4,618,564.77	2.66%
国寿安保尊利增强回报债券C	216	70,484.53	-	0.00%	15,224,658.10	100.00%
合计	354	1,328,639.35	169,006,800.00	89.49%	19,843,222.87	10.51%

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	国寿安保尊利增强回报债券 A	3,198.53	0.0000%
	国寿安保尊利增强回报债券 C	100.09	0.0000%
	合计	3,298.62	0.0000%

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

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以及本基金的基金经理均未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保尊利增强回报债券 A	国寿安保尊利增强回报债券 C
基金合同生效日 (2016 年 5 月 26 日) 基金份额总额	272,526,466.19	130,375,165.41
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	82,604.76	278,241.94
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	98,983,706.18	115,428,749.25
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,625,364.77	15,224,658.10

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金管理人于 2016 年 12 月 30 日发布公告，王军辉先生自 2016 年 12 月 28 日起任国寿安保基金管理有限公司董事长，相关任职资格已经中国证监会核准，刘慧敏先生因工作调动不再担任。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
银河证券		293,099,271.59	100.00%	68,082.88	100.00%	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
银河证券	29,913,848.47	100%	210,500,000.00	100%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金合同内容摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年4月30日
2	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年4月30日
3	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年4月30日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加好买基金费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年5月10日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年5月20日
6	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年5月27日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金新增基金经理的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年6月30日
8	国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定投业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016年7月1日
9	国寿安保基金管理有限公司系	《中国证券报》、《上	2016年7月8日

	统升级公告	海证券报》、《证券时报》及公司网站	
10	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额和最低保留余额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 9 日
11	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额申购业务并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 14 日
12	国寿安保基金关于参加诺亚正行费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 7 月 21 日
13	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加上海联泰资产管理有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 8 月 22 日
14	国寿安保基金管理有限公司新增北京汇成基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 26 日
15	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加北京懒猫金融信息服务有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 29 日
16	国寿安保基金管理有限公司新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 9 月 29 日
17	国寿安保基金管理有限公司 2016 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 10 月 24 日
18	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增上海华信证券有限责任公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 11 月 11 日
19	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增北京植信基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 22 日
20	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 22 日

	加费率优惠活动的公告		
21	国寿安保基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

- 12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfunds.com.cn
- 12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2017 年 3 月 28 日