

国寿安保增金宝货币市场基金  
2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：浙商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 25 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。本半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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14

6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	36
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	37
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	38
7.8 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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 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.....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>

---

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保增金宝货币市场基金
基金简称	国寿安保增金宝货币
基金主代码	001826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月23日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,283,625,628.59份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	7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，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 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	浙商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张彬	朱巍
	联系电话	010-50850744	0571-87659806
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		4009-258-258	95527

传真	010-50850776	0571-87658688
注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢306号	浙江省杭州市下城区庆春路288号
办公地址	北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层	浙江省杭州市下城区庆春路288号
邮政编码	100033	310006
法定代表人	王军辉	沈仁康

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	20,768,026.24
本期利润	20,768,026.24
本期净值收益率	1.9569%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末基金资产净值	1,283,625,628.59
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
累计净值收益率	5.6620%

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，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。

#### 3.2 基金净值表现

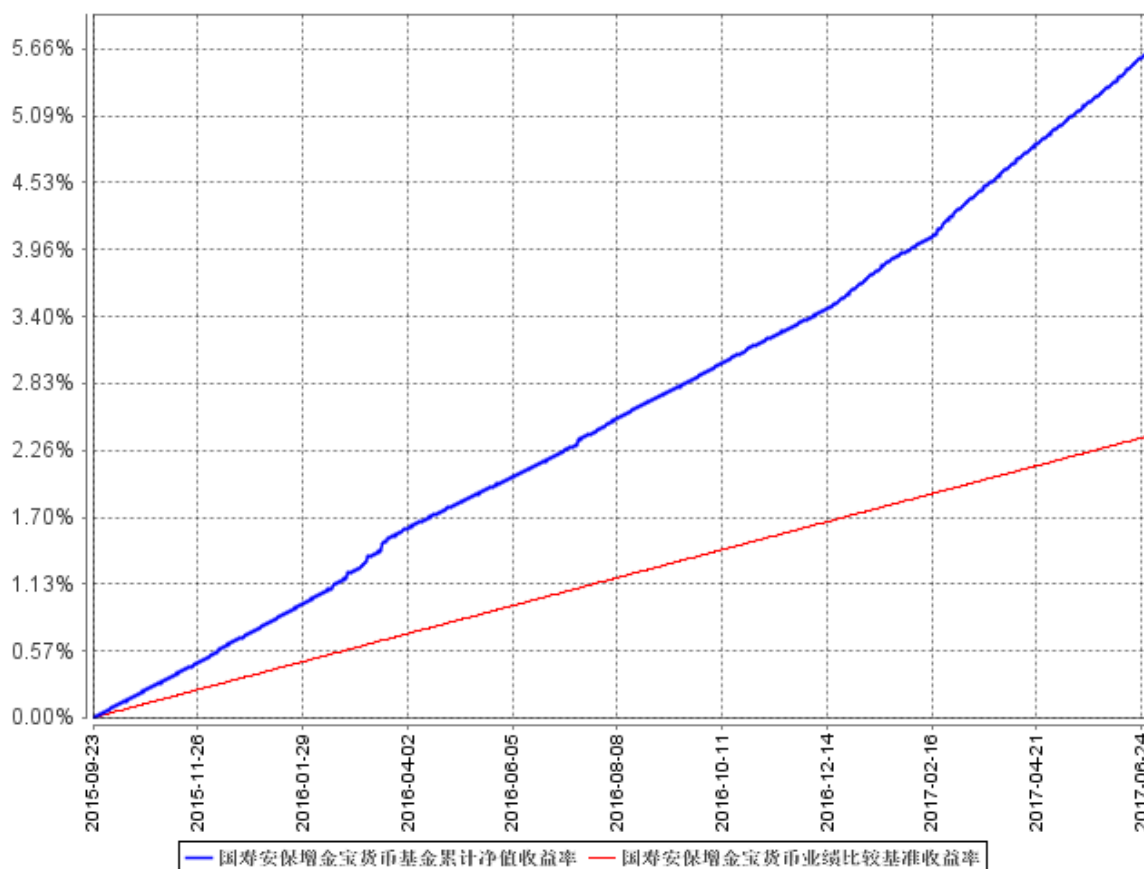
##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	0.3478%	0.0024%	0.1110%	0.0000%	0.2368%	0.0024%
过去三个月	1.0034%	0.0015%	0.3366%	0.0000%	0.6668%	0.0015%
过去六个月	1.9569%	0.0036%	0.6695%	0.0000%	1.2874%	0.0036%
过去一年	3.3766%	0.0035%	1.3481%	0.0000%	2.0285%	0.0035%
自基金合同 生效起至今	5.6620%	0.0041%	2.3893%	0.0000%	3.2727%	0.0041%



### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国寿安保增金宝货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于 2015 年 9 月 23 日生效，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。图示日期为 2015 年 9 月 23 日至 2017 年 6 月 30 日。

## § 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 2017 年 6 月 30 日，公司共管理 31 只开放式基金及部分特定资产管理计划，

公司管理资产总规模为 1410.13 亿元，其中公募基金管理规模 1006.76 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		
黄力	基金经理	2015 年 9 月 23 日	-	7 年	黄力先生，硕士，中国籍。曾任中国人寿资产管理有限公司投资经理助理；现任国寿安保货币市场基金、国寿安保增金宝货币市场基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《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。

##### 4.3.2 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

上半年宏观经济表现向好，海外经济复苏和人民币前期贬值效应带动进出口转暖，投资和消费较为强劲，尤其是工业企业利润好转带动制造业投资回暖，房地产销售带动房地产投资保持在较高水平。价格方面，CPI总体温和，PPI触顶回落，依旧保持在较高水平。融资需求整体维持较强水平。二季度始金融防风险、去杠杆的监管下，

流动性显著收紧，市场悲观情绪浓厚，债券收益率曲线平坦化上行。6月份协调监管加强，伴随去杠杆取得一定成果，债券收益率快速陡峭化下行。本基金秉持稳健投资原则，在确保组合流动性、安全性基础上，在预定到期日内以投资价值较高的同业存款和存单为主，在上半年大部分时间内稳健操作，总体维持了较低的杠杆和剩余期限，保持了较高的静态收益率，并在关键时点把握住配置机会，拉长组合剩余期限并适度增加杠杆，保持组合收益的稳定性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为1.9569%，业绩比较基准收益率为0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济的内生动力较上半年将有所减弱。出口持续回暖将会对经济继续构成支撑。房地产市场限购限贷政策以及贷款利率上升对销售和投资的抑制作用在下半年将会逐渐体现。地方政府融资行为受到规范后，基建投资强度可能难以维持。下半年通胀压力不大，总体将维持温和态势。货币政策将维持稳健中性，流动性总体将保持平稳，不排除个别时点出点阶段性紧张的可能性。投资中我们将继续密切关注经济走势和政策，保持账户流动性和安全性的基础上，适当拉长组合久期，根据市场情况灵活配置，并密切关注债券的交易性机会，为持有人创造稳定的投资回报。

#### 4.6 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其适用性的情况时，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和交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用1.00元固定份额净值交易方式，自基金成立日起每日将实现的基金净收益分配给基金份额持有人，并按日结转为基金份额，使基金账面份额净值始终保持

1.00元。

本基金本报告期内分配收益20,768,026.24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，本基金托管人在对国寿安保增金宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《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，国寿安保增金宝货币市场基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在国寿安保增金宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、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。本报告期内，国寿安保增金宝货币市场基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半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增金宝货币市场基金2017年半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复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保增金宝货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	740,038,580.31	225,644,917.61
结算备付金		8,501.12	-
存出保证金		3,611.30	16,958.01
交易性金融资产	6.4.7.2	632,463,671.77	129,893,008.31
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		632,463,671.77	129,893,008.31
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	118,920,618.38	109,471,329.96
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	7,146,502.62	2,134,532.12
应收股利		-	-
应收申购款		20,840,701.28	22,970,218.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,519,422,186.78	490,130,964.14
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		234,700,087.95	49,398,905.90
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		266,346.72	83,437.89
应付托管费		106,538.68	33,375.14
应付销售服务费		266,346.72	83,437.89
应付交易费用	6.4.7.7	25,077.95	16,576.77
应交税费		-	-
应付利息		17,545.43	10,539.16
应付利润		152,242.41	94,417.36
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	262,372.33	194,000.00
负债合计		235,796,558.19	49,914,690.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,283,625,628.59	440,216,274.03
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,283,625,628.59	440,216,274.03
负债和所有者权益总计		1,519,422,186.78	490,130,964.14

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额为 366,045,926.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保增金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2017年1月1日至 2017年6月30日	2016年1月1日至 2016年6月30日
<b>一、收入</b>		25,479,959.49	5,945,891.82
1.利息收入		24,866,035.14	5,407,125.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,947,951.30	3,702,142.67
债券利息收入		6,596,987.15	1,647,664.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,321,096.69	57,318.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		613,924.35	538,766.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	613,924.35	538,766.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		4,711,933.25	1,511,892.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,322,569.47	386,727.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	529,027.80	154,691.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,322,569.47	386,727.90
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,340,794.18	451,073.25
其中：卖出回购金融资产支出		1,340,794.18	451,073.25
6. 其他费用	6.4.7.20	196,972.33	132,672.14



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,768,026.24	4,433,999.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,768,026.24	4,433,999.42

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保增金宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	440,216,274.03	-	440,216,274.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,768,026.24	20,768,026.24
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）	843,409,354.56	-	843,409,354.56
其中：1.基金申购款	5,399,595,487.99	-	5,399,595,487.99
2.基金赎回款	-4,556,186,133.43	-	-4,556,186,133.43
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）	-	-20,768,026.24	-20,768,026.24
五、期末所有者权益（基金净值）	1,283,625,628.59	-	1,283,625,628.59

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	262,011,450.23	-	262,011,450.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,433,999.42	4,433,999.42
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）	104,034,476.14	-	104,034,476.14
其中：1.基金申购款	595,133,646.54	-	595,133,646.54
2.基金赎回款	-491,099,170.40	-	-491,099,170.40
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）	-	-4,433,999.42	-4,433,999.42
五、期末所有者权益（基金净值）	366,045,926.37	-	366,045,926.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保增金宝货币市场基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1952号文《关于准予国寿安保增金宝货币市场基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于2015年9月21日至2015年9月24日向社会公开发行募集，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（2015）验字第61090605\_A07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2015年9月23日正式生效，首次设立募集规模为310,106,135.96份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《货币市场基金监督管理办法》和《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为包括：现金、通知存款、短期融资券、超短期融资券、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，剩余期限（或回售期限）在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、中期票据、证券公司短期公司债券以及法律法规或中国证监会允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的金融工具。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《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3号《半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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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。

#### **6.4.3 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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 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]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1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。

#### 6.4.6.2 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[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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	38,580.31
定期存款	740,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	40,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	700,000,000.00
其他存款	-
合计：	740,038,580.31

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	632,463,671.77	632,854,000.00	390,328.23	0.0304%
	合计	632,463,671.77	632,854,000.00	390,328.23	0.0304%

##### 6.4.7.3 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。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	118,920,618.38	-
合计	118,920,618.38	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	16.25
应收定期存款利息	5,573,426.41
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3.80
应收债券利息	1,449,982.36
应收买入返售证券利息	123,072.20
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.60
合计	7,146,502.62

## 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	25,077.95
合计	25,077.95

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	262,372.33
合计	262,372.33

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	440,216,274.03	440,216,274.03
本期申购	5,399,595,487.99	5,399,595,487.99
本期赎回(以“-”号填列)	-4,556,186,133.43	-4,556,186,133.43
- 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	1,283,625,628.59	1,283,625,628.59

注：“本期申购”中包含基金份额升降级调增和红利再投份额及金额；“本期赎回”中含基金份额升降级调减份额及金额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	20,768,026.24	-	20,768,026.24
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-20,768,026.24	-	-20,768,026.24
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	2,266.95
定期存款利息收入	15,945,276.76
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	362.02
其他	45.57
合计	15,947,951.30

## 6.4.7.12 股票投资收益

本基金于本报告期无买卖股票差价收入。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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	613,924.35
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	613,924.35

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	484,773,534.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	480,660,995.57
减：应收利息总额	3,498,614.69
买卖债券差价收入	613,924.35

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无买卖贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金于本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金于本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

本基金于本报告期无交易费用。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
中债登账户维护费	8,926.92
上清所账户维护费	8,926.92
其他	600.00
合计	196,972.33

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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
浙商银行股份有限公司（简称“浙商银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	中国人寿保险集团公司（基金管理人的最终控制人）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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,322,569.47	386,727.90
其中：支付销售机构的客户维护费	344,048.08	11,507.69

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金合同生效日管理费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

R 为基金管理费年费率

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	529,027.80	154,691.21

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金合同生效日托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提；计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

### 6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
浙商银行	204,240.27
国寿安保	403,932.82
合计	608,173.09
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
浙商银行	38,289.04
国寿安保	348,386.19
合计	386,675.23

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提，计算公式如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

R为该类基金份额的销售服务费率

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日

基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	118,781,338.17	0.00
期间申购/买入总份额	252,568,566.02	52,606,893.70
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	220,000,000.00	0.00
期末持有的基金份额	151,349,904.19	52,606,893.70
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.79%	14.37%

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 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	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	158,473,739.31	12.35%	153,305,221.23	41.88%

#### 6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行	38,580.31	2,266.95	17,509.86	2,745.43

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接通过关联方购入证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
20,710,201.19	-	57,825.05	20,768,026.24	-

#### 6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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的证券。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30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234,700,087.95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
111794733	17 富滇银行 CD051	2017 年 7 月 3 日	98.84	300,000	29,650,888.46
111715184	17 民生银行 CD184	2017 年 7 月 3 日	98.99	1,000,000	98,989,951.79
111790180	17 绍兴银行 CD002	2017 年 7 月 3 日	99.88	208,000	20,774,193.08
011751056	17 苏国信 SCP009	2017 年 7 月 3 日	99.98	1,000,000	99,983,684.82
合计				2,508,000	249,398,718.15

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### **6.4.13.2 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债券、国债、央行票据等，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；本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。

#### **6.4.13.3 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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，均能够及时变现。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约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。

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。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	70,038,580.31	390,000,000.00	280,000,000.00	-	-	-	740,038,580.31
结算备付金	8,501.12	-	-	-	-	-	8,501.12
存出保证金	3,611.30	-	-	-	-	-	3,611.30
交易性金融资产	29,962,778.48	357,794,156.26	244,706,737.03	-	-	-	632,463,671.77
买入返售金融资产	118,920,618.38	-	-	-	-	-	118,920,618.38
应收利息	-	-	-	-	-	7,146,502.62	7,146,502.62
应收申购款	-	-	-	-	-	20,840,701.28	20,840,701.28
资产总计	218,934,089.59	747,794,156.26	524,706,737.03	-	-	27,987,203.90	1,519,422,186.78
负债							
卖出回购金融资产款	234,700,087.95	-	-	-	-	-	234,700,087.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	266,346.72	266,346.72
应付托管费	-	-	-	-	-	106,538.68	106,538.68
应付销售服务费	-	-	-	-	-	266,346.72	266,346.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,077.95	25,077.95
应付利息	-	-	-	-	-	17,545.43	17,545.43
应付利润	-	-	-	-	-	152,242.41	152,242.41
其他负债	-	-	-	-	-	262,372.33	262,372.33
负债总计	234,700,087.95	-	-	-	-	1,096,470.24	235,796,558.19
利率敏感度缺口	-15,765,998.36	747,794,156.26	524,706,737.03	-	-	-26,890,733.66	1,283,625,628.59
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	144,917.61	225,500,000.00	-	-	-	-	225,644,917.61
存出保证金	16,958.01	-	-	-	-	-	16,958.01



交易性金融资产	-	20,079,284.23	109,813,724.08	-	-	-	129,893,008.31
买入返售金融资产	89,473,179.96	19,998,150.00	-	-	-	-	109,471,329.96
应收利息	-	-	-	-	-	2,134,532.12	2,134,532.12
应收申购款	-	-	-	-	-	22,970,218.13	22,970,218.13
资产总计	89,635,055.58	265,577,434.23	109,813,724.08	-	-	25,104,750.25	490,130,964.14
负债							
卖出回购金融资产款	49,398,905.90	-	-	-	-	-	49,398,905.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	83,437.89	83,437.89
应付托管费	-	-	-	-	-	33,375.14	33,375.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83,437.89	83,437.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	16,576.77	16,576.77
应付利息	-	-	-	-	-	10,539.16	10,539.16
应付利润	-	-	-	-	-	94,417.36	94,417.36
其他负债	-	-	-	-	-	194,000.00	194,000.00
负债总计	49,398,905.90	-	-	-	-	515,784.21	49,914,690.11
利率敏感度缺口	40,236,149.68	265,577,434.23	109,813,724.08	0.00	0.00	24,588,966.04	440,216,274.03

注：表中所示为本基金资产及负债的余额，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产公允价值产生的影响。于2017年6月30日，在“影子定价”机制有效的前提下，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产公允价值不会发生重大变动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **6.4.14.1 公允价值**

银行存款、结算备付金、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且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币632,463,671.77元，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无重大转移。

本基金本报告期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未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

##### **6.4.14.2 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。

##### **6.4.14.3 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。

##### **6.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2017 年 8 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	632,463,671.77	41.63
	其中: 债券	632,463,671.77	41.63
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	118,920,618.38	7.83
	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	740,047,081.43	48.71
4	其他各项资产	27,990,815.20	1.84
5	合计	1,519,422,186.78	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	8.50	
	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	234,700,087.95	18.28
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 本基金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个交易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

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

#### 7.3.2 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	17.06	18.28
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	45.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天 (含)	35.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		116.19	18.28

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

#### 7.5 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	70,002,439.58	5.45
	其中：政策性金融债	70,002,439.58	5.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	109,981,770.71	8.57
6	中期票据	-	-
7	同业存单	452,479,461.48	35.25
8	其他	-	-
9	合计	632,463,671.77	49.27
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	011751056	17 苏国信 SCP009	1,000,000	99,983,684.82	7.79
2	111715184	17 民生银行 CD184	1,000,000	98,989,951.79	7.71
3	111698975	16 晋商银行 CD024	500,000	49,261,561.50	3.84
4	111799966	17 重庆银行 CD109	500,000	48,883,594.01	3.81
5	111792234	17 烟台银行 CD001	400,000	39,728,617.96	3.10
6	111790180	17 绍兴银行 CD002	300,000	29,962,778.48	2.33
7	111697242	16 河北银行 CD042	300,000	29,731,467.69	2.32

8	111697361	16 成都农商银行 CD023	300,000	29,727,141.54	2.32
9	111794733	17 富滇银行 CD051	300,000	29,650,888.46	2.31
10	111799415	17 青岛农商行 CD037	300,000	29,322,378.89	2.28

### 7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0467%
报告期内偏离度的最低值	-0.0923%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0228%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

**7.9.1** 本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持为人民币 1.00 元。本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法摊销，每日计提收益或损失。

**7.9.2** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 7.9.3 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	3,611.30
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,146,502.62
4	应收申购款	20,840,701.28

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	27,990,815.20

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
100,929	12,718.11	343,928,070.02	26.79%	939,697,558.57	73.21%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	168,592.67	0.01%

### 8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 9 月 23 日）基金份额总额	310,106,135.96
本报告期期初基金份额总额	440,216,274.03
本报告期基金总申购份额	5,399,595,487.99
减：本报告期基金总赎回份额	4,556,186,133.43
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,283,625,628.59

注：本期申购中包含基金份额升降级调增和红利再投份额，本期赎回中含基金份额升降级调减份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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) 本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。
- (2) 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。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》

（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

(1) 综合实力较强、市场信誉良好；

(2) 财务状况良好，经营状况稳健；

(3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；

(4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

(5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；

(6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 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
华泰证券	12,994,744.20	100.00%	16,200,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本基金在本报告期内不存在偏离度绝对值在0.5%（含）以上的情况。

### 10.9 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	国寿安保增金宝货币市场基金 2016 年第 4 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 21 日
2	关于国寿安保增金宝货币市场基金 2017 年春节假期暂停申购、转换转入业务的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 1 月 23 日

3	国寿安保增金宝货币市场基金 2016 年度报告（摘要）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 3 月 28 日
4	国寿安保增金宝货币市场基金 2017 年第 1 季度报告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 4 月 22 日
5	国寿安保增金宝货币市场基金更新招募说明书（摘要）（2017 年第 1 号）	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 5 月 7 日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报及公司网站	2017 年 5 月 8 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170125、 20170207、 20170210-20170302	155,417,311.80	3,056,427.51	0.00	158,473,739.31	12.35%
	2	20170101-20170111、 20170119-20170125、 20170208-20170219	118,781,338.17	252,568,566.02	220,000,000.00	151,349,904.19	11.79%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。

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，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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增金宝货币市场基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保增金宝货币市场基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保增金宝货币市场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](http://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8月25日