

国寿安保尊裕优化回报  
债券型证券投资基金  
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 3 月 23 日（基金合同生效日）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>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
<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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	42
7.7 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.....	42
7.8 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.....	42
7.9 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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.11 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金	
基金简称	国寿安保尊裕优化回报债券	
基金主代码	004318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	75,646,638.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
下属分级基金的交易代码:	004318	004319
报告期末下属分级基金的份额总额	72,327,171.63 份	3,319,466.97 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,并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	中国建设银行股份有限公司
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	010-67595096
传真	010-50850776	010-66275853
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	王军辉	王洪章

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
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

基金级别	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017 年 3 月 23 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 3 月 23 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,334,769.34	110,703.86
本期利润	1,510,984.56	131,222.79
加权平均基金份额本期利润	0.0086	0.0077
本期加权平均净值利润率	0.86%	0.77%
本期基金份额净值增长率	1.60%	1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	907,342.74	36,823.51
期末可供分配基金份额利润	0.0125	0.0111
期末基金资产净值	73,453,085.11	3,366,306.25
期末基金份额净值	1.016	1.014
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	1.60%	1.40%

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

国寿安保尊裕优化回报债券 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
过去一个月	1.20%	0.13%	0.90%	0.06%	0.30%	0.07%

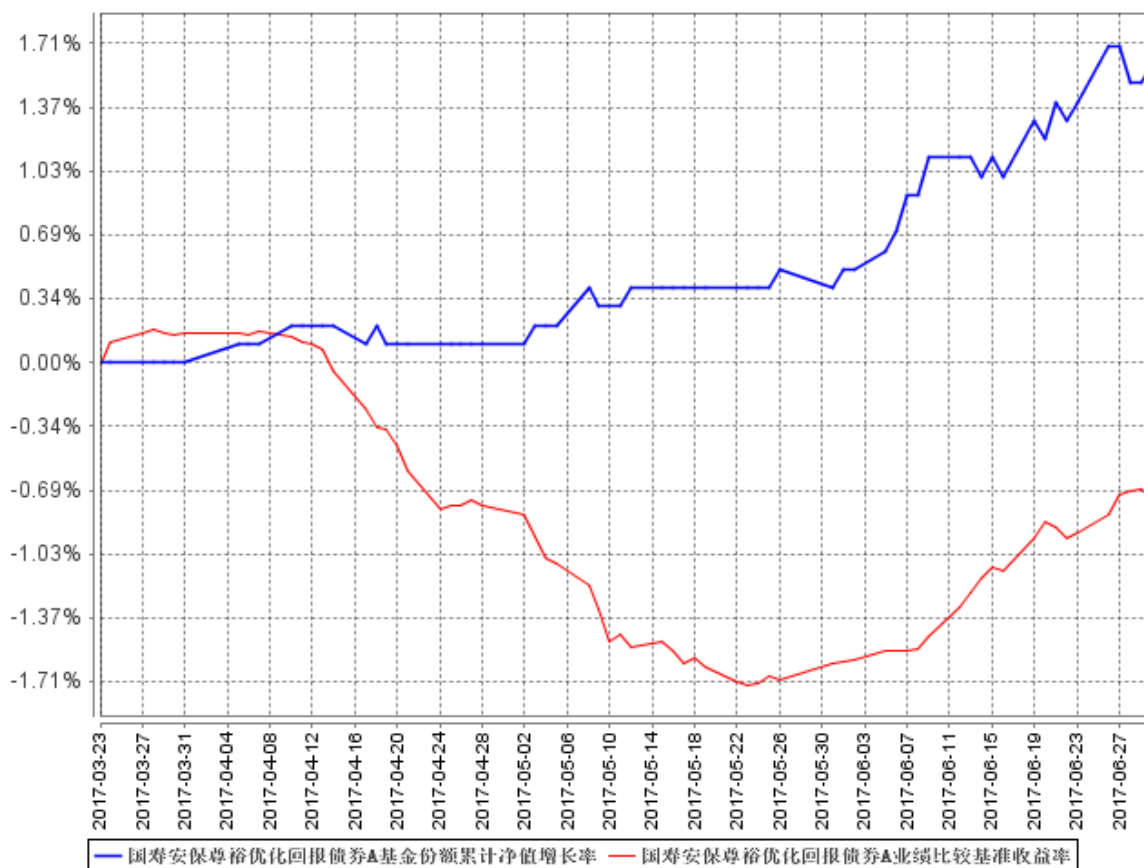
过去三个月	1.60%	0.09%	-0.88%	0.08%	2.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.09%	-0.73%	0.08%	2.33%	0.01%

国寿安保尊裕优化回报债券 C

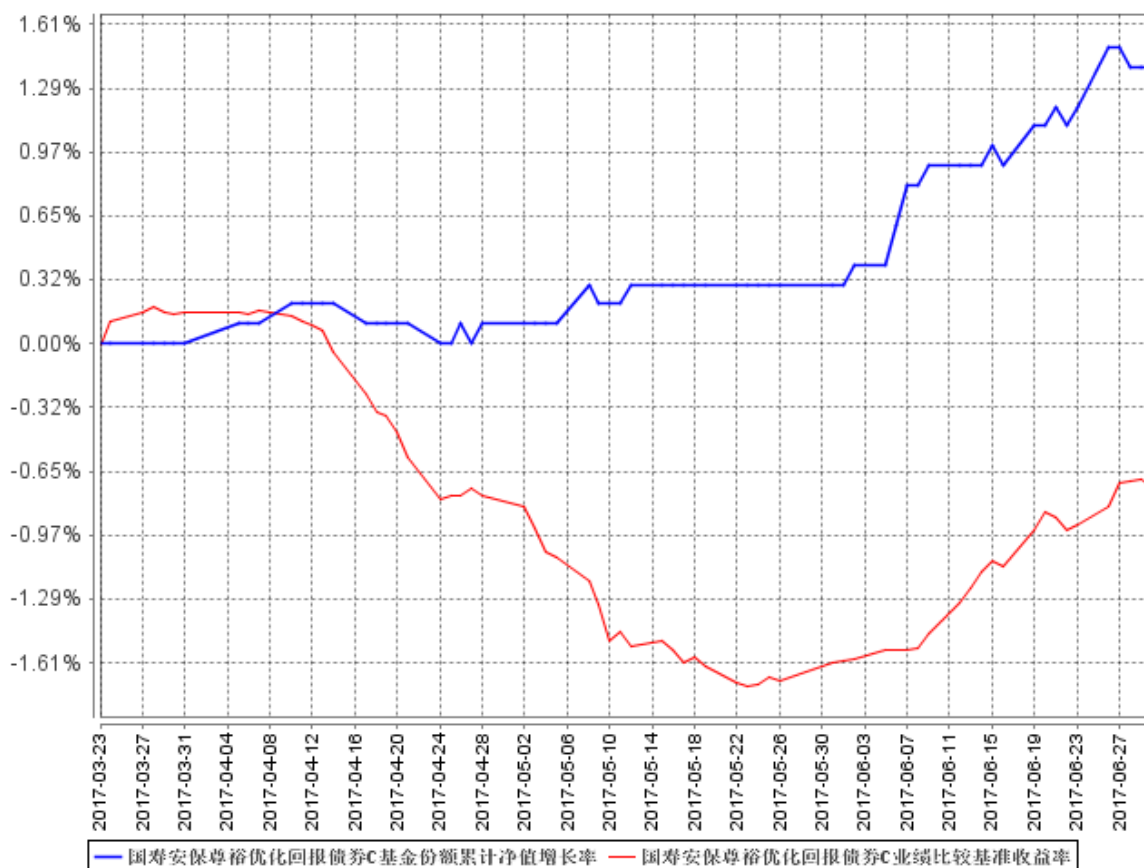
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.10%	0.10%	0.90%	0.06%	0.20%	0.04%
过去三个月	1.40%	0.08%	-0.88%	0.08%	2.28%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.40%	0.08%	-0.73%	0.08%	2.13%	0.00%

### 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

国寿安保尊裕优化回报债券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



国寿安保尊裕优化回报债券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：本基金的基金合同于 2017 年 3 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。本报告期末，本基金建仓期尚未结束。图示日期为 2017 年 3 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 (澳大利亚安资本投资有限公司),其持有股份 14.97%。

截至 2017 年 06 月 30 日,公司共管理 31 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 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		
董瑞倩	投资管理部总经理、基金经理	2017 年 3 月 23 日	-	20 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、国寿安保稳恒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、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保稳信混合型证券投资基金及国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金经理。
吴闻	基金经理	2017 年 3 月 23 日	-	9 年	吴闻先生, 硕士。曾任中信证券股份有限公司债务

					资本市场部高级经理，固定收益部副总裁，2014 年 9 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保稳恒混合型证券投资基金、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、国寿安保稳荣混合型证券投资基金及国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

##### 4.3.2 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

2017 年上半年中国经济走势稳中向好，海外经济复苏延续使得出口保持回暖态势，房地产投资与基建投资仍然维持动能，制造业投资在企业利润改善的推动下呈现

底部企稳特征。物价方面，以猪肉为代表的食品价格走势继续低迷，核心通胀也跟随房价和工业品价格开始回落。政策方面，央行在 1 月和 3 月上调了 MLF 利率与公开市场利率，货币政策基调稳健中性，但 6 月以来金融去杠杆初见成效，通过加大公开市场投放和提前续作 MLF 来维稳资金面。

上半年债市收益率先升后稳，1 季度受央行上调 MLF 利率的影响，债券市场利率总体上行，4 月银监会连续发文提升监管力度，委外资金和同业理财的赎回使得债券抛售压力大增，债券市场深度调整。此后 6 月在监管协调加强和央行维稳资金面的推动下债券市场转暖，收益率曲线陡峭化下行。

权益市场方面，从企业盈利端来看，随着供给侧改革的有效推进以及市场的自然出清，实体经济得到了一定程度的改善，企业效益提升，工业企业的资产负债表得到显著的修复。A 股市场仍面临企业盈利修复和市场流动性中性的组合。回归基本面主导的方向始终贯穿 2017 年上半年，估值体系的分化和重构仍是市场的主旋律。进入二季度，金融去杠杆加速驱动利率上升抑制了 A 股估值水平及风险偏好，市场交易呈现高度集中化的趋势，市场热点集中聚焦在食品饮料、家电以及消费电子等业绩增长稳定的龙头白马上，而周期与计算机、传媒等高估值板块都出现了较大幅度的调整。

投资运作方面，本基金在报告期内以短期存单为主要配置品种，在控制仓位的基础上参与可转债交易，股票持仓以优质公司为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保尊裕优化回报债券 A 基金份额净值为 1.016 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.60%；截至本报告期末国寿安保尊裕优化回报债券 C 基金份额净值为 1.014 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.40%；同期业绩比较基准收益率为-0.73%。

#### 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 年下半年海外经济总体仍在复苏进程中，欧元区经济复苏动能逐渐增强，预计年内欧央行货币政策也会迎来转向，在此之前预计美元维持弱势。中国的名义经济增速已于 1 季度见顶，下半年也将逐渐回落，但由于出口持续回暖对经济构成支撑，部分前期滞涨的三线城市销售仍然较强，加上地方政府加大土地供给也支撑了房地产投资增速，经济的韧性仍然较强。中国经济的潜在下行风险在于基建投资难以维持强度，地方平台的融资能力预计将受到 87 号文等政策的限制。预计下半年通胀预期继续回落，商品和房价后期面临回落压力，劳动力市场也将由紧转松。

从政策面来看，经过前期对同业业务的治理整顿，金融去杠杆初见成效，货币政策下半年不会更紧，但是货币政策再度放松预计也需要时间。下半年债券市场的机会多于风险，债券利率可能有一定的下行空间，3 季度货币政策以稳为主，资金利率波动性下降，预计到 4 季度才能观察到经济回落的进一步信号。权益市场方面，随着传统行业进入成熟期，行业利润逐渐向龙头企业集中，市场将继续保持对企业盈利的高度关注。

本基金未来将采取更加灵活的投资策略，继续优化债券持仓结构，并且密切关注长期利率债及转债的波段交易机会；股票投资将更加注重估值与盈利增长的匹配度，寻找行业景气度较好、估值合理的优质公司。

#### **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**

本基金报告期内未进行利润分配。

#### **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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	1,084,576.83
结算备付金		1,707,487.73
存出保证金		10,319.78
交易性金融资产	6.4.7.2	61,529,731.81
其中：股票投资		2,293,548.80
基金投资		-
债券投资		59,236,183.01
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	22,698,150.00
应收证券清算款		1,464.66

应收利息	6.4.7.5	808,021.91
应收股利		-
应收申购款		9.92
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		87,839,762.64
<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>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		9,999,785.00
应付证券清算款		-
应付赎回款		850,956.17
应付管理人报酬		53,169.45
应付托管费		13,292.35
应付销售服务费		2,214.77
应付交易费用	6.4.7.7	48,702.28
应交税费		-
应付利息		3,020.34
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	49,230.92
负债合计		11,020,371.28
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	75,646,638.60
未分配利润	6.4.7.10	1,172,752.76
所有者权益合计		76,819,391.36
负债和所有者权益总计		87,839,762.64

注:报告截止日 2017 年 6 月 30 日,国寿安保尊裕优化回报债券 A 类基金份额净值人民币 1.016 元,国寿安保尊裕优化回报债券 C 类基金份额净值人民币 1.014 元,基金份额总额 75,646,638.60 份,其中国寿安保尊裕优化回报债券 A 类基金份额总额 72,327,171.63 份,国寿安保尊裕优化回报债券 C 类基金份额总额 3,319,466.97 份。

## 6.2 利润表

会计主体:国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金

本报告期:2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期
		2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6

		月 30 日
<b>一、收入</b>		2,366,091.88
1.利息收入		2,215,642.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,116,316.49
债券利息收入		532,592.49
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		566,733.78
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-121,949.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-497,053.87
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	272,824.42
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	102,280.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	196,734.15
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	75,664.42
<b>减：二、费用</b>		723,884.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	425,356.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	106,339.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	18,729.51
4. 交易费用	6.4.7.19	71,626.19
5. 利息支出		46,758.85
其中：卖出回购金融资产支出		46,758.85
6. 其他费用	6.4.7.20	55,073.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,642,207.35
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,642,207.35

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金

本报告期：2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月23日(基金合同生效日)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)	349,448,765.65	-	349,448,765.65
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	1,642,207.35	1,642,207.35
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)	-273,802,127.05	-469,454.59	-274,271,581.64
其中: 1.基金申购款	67,879.35	254.22	68,133.57
2.基金赎回款	-273,870,006.40	-469,708.81	-274,339,715.21
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)	75,646,638.60	1,172,752.76	76,819,391.36

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

国寿安保国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金（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[2016]926 号文《关于核准国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于 2017 年 2 月 27 日至 2017 年 3 月 24 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（2017）验字第 61090605\_A05 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 2017 年 3 月 23 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，且在赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额，称为 A 类基金



份额；在投资者认（申）购时，不收取认（申）购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费的基金份额，称为 C 类基金份额。首次募集规模为 319,286,871.13 份 A 类基金份额，30,161,894.52 份 C 类基金份额。国寿安保尊享债券 A 类及 C 类收到的实收基金合计人民币 349,448,765.65 元，分别折合成 A 类和 C 类基金份额，合计折合 349,448,765.65 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管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资人可自行选择认/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。基金管理人可在符合法律法规和监管规定且不损害已有基金份额持有人权益的情况下，调整基金份额类别的设置、费率水平及其他具体规则，且无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须在开始调整之日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

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）。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%。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

#### 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

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 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。

#### **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 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日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**

本报告期内所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致。

##### **6.4.4.1 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 2017 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 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。

##### **6.4.4.3 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。

#### 6.4.4.4 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。

### 6.4.4.5 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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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）”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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 0.40% 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。

#### 6.4.4.11 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) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

(6) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金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。

#### 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

本基金于本报告期均无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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]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 01 月 01 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 01 月 01 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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

#### 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	1,084,576.83
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,084,576.83

##### 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			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,253,317.66	2,293,548.80	40,231.14	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	20,002,820.00	20,094,183.01	91,363.01
	银行间市场	39,076,860.00	39,142,000.00	65,140.00
	合计	59,079,680.00	59,236,183.01	156,503.01
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	61,332,997.66	61,529,731.81	196,734.15	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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	19,998,150.00	-
买入返售证券	2,700,000.00	-
合计	22,698,150.00	-

#### 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	537.54
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	768.30
应收债券利息	775,202.16
应收买入返售证券利息	31,509.31
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.60
合计	808,021.91

### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本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	37,779.00
银行间市场应付交易费用	10,923.28
合计	48,702.28

## 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	638.92
预提费用	48,592.00
合计	49,230.92

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保尊裕优化回报债券 A		
项目	本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	319,286,871.13	319,286,871.13
本期申购	31,533.45	31,533.45
本期赎回(以“-”号填列)	-246,991,232.95	-246,991,232.95
- 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	72,327,171.63	72,327,171.63

金额单位：人民币元

国寿安保尊裕优化回报债券 C		
项目	本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	30,161,894.52	30,161,894.52
本期申购	36,345.90	36,345.90
本期赎回(以“-”号填列)	-26,878,773.45	-26,878,773.45
- 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	3,319,466.97	3,319,466.97

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保尊裕优化回报债券 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	1,334,769.34	176,215.22	1,510,984.56
本期基金份额交易产生的变动数	-427,426.60	42,355.52	-385,071.08
其中：基金申购款	141.24	18.88	160.12
基金赎回款	-427,567.84	42,336.64	-385,231.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	907,342.74	218,570.74	1,125,913.48

单位：人民币元

国寿安保尊裕优化回报债券 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	110,703.86	20,518.93	131,222.79
本期基金份额交易产生的变动数	-73,880.35	-10,503.16	-84,383.51
其中：基金申购款	85.76	8.34	94.10
基金赎回款	-73,966.11	-10,511.50	-84,477.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,823.51	10,015.77	46,839.28

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	38,134.85
定期存款利息收入	1,073,244.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,909.90
其他	27.30
合计	1,116,316.49

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	22,402,933.22

减：卖出股票成本总额	22,899,987.09
买卖股票差价收入	-497,053.87

### 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3月23日(基金合同生效日)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	272,824.42
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	272,824.42

#### 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3月23日(基金合同生效日)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	208,817,511.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	206,958,955.20
减：应收利息总额	1,585,731.84
买卖债券差价收入	272,824.42

#### 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

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6
----	----------------------------------

	月 30 日
股票投资产生的股利收益	102,280.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	102,280.00

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	196,734.15
——股票投资	40,231.14
——债券投资	156,503.01
——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	196,734.15

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	68,675.44
其他	6,988.98
合计	75,664.42

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	65,701.19
银行间市场交易费用	5,925.00
合计	71,626.19

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	21,127.00
信息披露费	27,465.00
银行费用	6,081.97
其他	400.00
合计	55,073.97

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化

##### 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”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）	基金托管人、销售机构
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受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。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.1 关联方报酬

###### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	425,356.82
其中：支付销售机构的客户维护费	202,920.46

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 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 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	106,339.19

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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.1.3 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		
	2017 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊裕优化 回报债券 A	国寿安保尊裕优化 回报债券 C	合计
建设银行	-	18,351.56	18,351.56
国寿安保	-	9.71	9.71
合计	-	18,361.27	18,361.27

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 0.40%。

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 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产划出，经登记机构分别支付给各个基金销售机构。

**6.4.10.2 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。

**6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期末基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

**6.4.10.3.2 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**

国寿安保尊裕优化回报债券 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30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	40,000,800.00	55.31%

**6.4.10.4 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 2017年3月23日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	1,084,576.83	38,134.85

**6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.6 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期间未进行利润分配。

**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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

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
111695506	16 广州农村 商业银行 CD107	2017 年 7 月 6 日	96.98	100,000	9,698,000.00
111791490	17 包商银行 CD022	2017 年 7 月 6 日	96.68	100,000	9,668,000.00
合计				200,000	19,366,000.00

### 6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证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；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。

#### 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、结算保证金及债券投资等。

##### 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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,084,576.83	-	-	-	1,084,576.83
结算备付金	1,707,487.73	-	-	-	1,707,487.73
存出保证金	10,319.78	-	-	-	10,319.78
交易性金融资产	54,680,922.21	4,555,260.80	-	2,293,548.80	61,529,731.81
买入返售金融资产	22,698,000.00	-	-	150.00	22,698,150.00
应收证券清算款	-	-	-	1,464.66	1,464.66
应收利息	-	-	-	808,021.91	808,021.91
应收申购款	-	-	-	9.92	9.92
资产总计	80,181,306.55	4,555,260.80	-	3,103,195.29	87,839,762.64
负债					
卖出回购金融资产款	9,999,785.00	-	-	-	9,999,785.00

应付赎回款	-	-	-	850,956.17	850,956.17
应付管理人报酬	-	-	-	53,169.45	53,169.45
应付托管费	-	-	-	13,292.35	13,292.35
应付销售服务费	-	-	-	2,214.77	2,214.77
应付交易费用	-	-	-	48,702.28	48,702.28
应付利息	-	-	-	3,020.34	3,020.34
其他负债	-	-	-	49,230.92	49,230.92
负债总计	9,999,785.00	-	-	1,020,586.28	11,020,371.28
利率敏感度缺口	70,181,521.55	4,555,260.80	-	2,082,609.01	76,819,391.36

#### 6.4.13.4.1.2 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（2017 年 6 月 30 日）
	+25 个基点	-158,678.32
	-25 个基点	158,678.32

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和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%。本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。于 2017 年 6 月 30 日，本基金无重大价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,293,548.80	2.99
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	59,236,183.01	77.11
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	61,529,731.81	80.10

注：于 2017 年 06 月 30 日，本基金无重大价格风险。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2017 年 06 月 30 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。

#### 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、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 2,293,548.80 元，属于第二层次的余额为人民币 59,236,183.01 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

2017 年度，对于以公允价值计量的金融工具，第一层次和第二层次之间均无重大转移。本基金本报告期间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。

##### 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	权益投资	2,293,548.80	2.61
	其中：股票	2,293,548.80	2.61
2	固定收益投资	59,236,183.01	67.44
	其中：债券	59,236,183.01	67.44
	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	22,698,150.00	25.84
	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	2,792,064.56	3.18
7	其他各项资产	819,816.27	0.93
8	合计	87,839,762.64	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,293,548.80	2.99
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	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	2,293,548.80	2.99

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资组合。

### 7.3 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	002241	歌尔股份	118,960	2,293,548.80	2.99

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	002241	歌尔股份	4,375,280.76	5.70
2	600004	白云机场	2,615,593.53	3.40
3	600664	哈药股份	1,999,574.00	2.60
4	600011	华能国际	1,999,449.00	2.60
5	601006	大秦铁路	1,997,304.00	2.60
6	603377	东方时尚	1,494,698.00	1.95
7	600170	上海建工	999,804.00	1.30
8	000425	徐工机械	999,607.00	1.30
9	000937	冀中能源	999,600.00	1.30
10	600827	百联股份	999,396.00	1.30
11	600895	张江高科	999,334.00	1.30
12	601111	中国国航	999,249.00	1.30
13	600585	海螺水泥	999,244.00	1.30
14	600305	恒顺醋业	999,154.00	1.30
15	002236	大华股份	999,056.46	1.30
16	600648	外高桥	998,490.00	1.30
17	601989	中国重工	399,465.00	0.52
18	600377	宁沪高速	279,006.00	0.36



## 7.4.2 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	600004	白云机场	2,849,965.35	3.71
2	002241	歌尔股份	2,144,728.00	2.79
3	600011	华能国际	2,077,212.00	2.70
4	601006	大秦铁路	2,030,600.00	2.64
5	600664	哈药股份	1,573,172.00	2.05
6	603377	东方时尚	1,341,713.00	1.75
7	601111	中国国航	1,111,203.00	1.45
8	600585	海螺水泥	1,034,550.00	1.35
9	600305	恒顺醋业	1,029,712.00	1.34
10	002236	大华股份	1,015,481.87	1.32
11	600648	外高桥	955,662.00	1.24
12	600895	张江高科	946,813.00	1.23
13	600827	百联股份	942,480.00	1.23
14	600170	上海建工	926,840.00	1.21
15	000937	冀中能源	898,960.00	1.17
16	000425	徐工机械	879,045.00	1.14
17	601989	中国重工	364,320.00	0.47
18	600377	宁沪高速	280,476.00	0.37

## 7.4.3 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	25,153,304.75
卖出股票收入（成交）总额	22,402,933.22

## 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	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	4,490,550.00	5.85
	其中：政策性金融债	4,490,550.00	5.85
4	企业债券	7,583,300.00	9.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,020,333.01	10.44

8	同业存单	39,142,000.00	50.95
9	其他	-	-
10	合计	59,236,183.01	77.11

## 7.6 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	111709203	17 浦发银行 CD203	100,000	9,888,000.00	12.87
1	111711210	17 平安银行 CD210	100,000	9,888,000.00	12.87
2	111695506	16 广州农村商业银行 CD107	100,000	9,698,000.00	12.62
3	111791490	17 包商银行 CD022	100,000	9,668,000.00	12.59
4	108601	国开 1703	45,000	4,490,550.00	5.85
5	127004	模塑转债	35,223	4,070,722.11	5.30

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.11.2 基金投资前十名股票未超出基金合同的投资范围。

### 7.11.3 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	10,319.78
2	应收证券清算款	1,464.66
3	应收股利	-
4	应收利息	808,021.91
5	应收申购款	9.92
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	819,816.27

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113009	广汽转债	1,112,850.00	1.45
2	132001	14 宝钢 EB	901,185.00	1.17
3	120001	16 以岭 EB	602,860.80	0.78

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.11.6 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

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
国寿安保尊裕优化回报债券 A	298	242,708.63	59,998,700.00	82.95%	12,328,471.63	17.05%
国寿安保尊裕优化回报债券 C	146	22,736.08	-	-	3,319,466.97	100.00%
合计	444	170,375.31	59,998,700.00	79.31%	15,647,938.60	20.69%

### 8.2 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	国寿安保尊裕优化回报债券 A	39.80	0.0001%
	国寿安保尊裕优化回报债券 C	5,153.52	0.1553%
	合计	5,193.32	0.0069%

### 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保尊裕优化回报债券 A	国寿安保尊裕优化回报债券 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 23 日）基金份额总额	319,286,871.13	30,161,894.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	31,533.45	36,345.90
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	246,991,232.95	26,878,773.45
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）	-	-
本报告期末基金份额总额	72,327,171.63	3,319,466.97

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本报告期内，基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门均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	
申万宏源	2	40,565,363.68	100.00%	37,779.00	100.00%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
长江证券	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，本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
申万宏源	81,013,824.78	9.21%	758,100,000.00	86.18%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金合同内容摘要	中证报及公司网站	2017年2月22日
2	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金份额发售公告	中证报及公司网站	2017年2月22日
3	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金招募说明书	中证报及公司网站	2017年2月22日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金新增招商银行及中国银行为销售机构的公告	中证报及公司网站	2017年2月28日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金新增广发银行股份有限公司为销售机构的公告	中证报及公司网站	2017年3月1日
6	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中证报及公司网站	2017年3月6日
7	关于国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金提前结	中证报及公司网站	2017年3月14日

	束募集的公告		
8	国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金合同生效公告	中证报及公司网站	2017 年 3 月 24 日
9	国寿安保尊裕优化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	中证报及公司网站	2017 年 4 月 26 日
10	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	20170503-20170630	0.00	40,000,800.00	0.00	40,000,800.00	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

### 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尊裕优化回报债券型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保尊裕优化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裕优化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.gsfoods.com.cn](http://www.gsfoods.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