

国联安货币市场证券投资基金
2017 年年度报告
2017 年 12 月 31 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 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，毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 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
§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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	18
§6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 债券回购融资情况	51
8.3 基金投资组合平均剩余期限	52
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	53

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	53
8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	54
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	54
8.9 投资组合报告附注	54
§9 基金份额持有人信息	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	55
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.4 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	56
§10 开放式基金份额变动	56
§11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	59
11.9 其他重大事件	59
12 影响投资者决策的其他重要信息	62
§13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安货币市场证券投资基金	
基金简称	国联安货币	
基金主代码	253050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 1 月 26 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,949,018,178.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安货币 A	国联安货币 B
下属分级基金的交易代码	253050	253051
报告期末下属分级基金的份额总额	148,874,984.76 份	4,800,143,193.27 份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	朱萍
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	上海市中山东一路12号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	上海市中山东一路12号
邮政编码		200121	200120
法定代表人		虞启斌	高国富

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、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtja-allianz.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼
注册登记机构	国联安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年		2015 年	
	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B
本期已实现收益	3,200,928.75	117,476.031.24	1,457,025.68	383,996.967.59	4,742,575.38	75,983,657.34
本期利润	3,200,928.75	117,476.031.24	1,457,025.68	383,996.967.59	4,742,575.38	75,983,657.34
本期净值收益率	3.4743%	3.7231%	2.5553%	2.8016%	3.2153%	3.4655%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B
期末基金资产净值	148,874.984.76	4,800,143.193.27	126,067.103.28	16,993,936.355.89	86,418,359.35	10,120,981.676.89
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B	国联安货币 A	国联安货币 B
累计净值收益率	25.7467%	27.8593%	21.5246%	23.2699%	18.4967%	19.9104%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

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

3、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 国联安货币 A:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9759%	0.0025%	0.3403%	0.0000%	0.6356%	0.0025%
过去六个月	1.9932%	0.0025%	0.6805%	0.0000%	1.3127%	0.0025%
过去一年	3.4743%	0.0029%	1.3500%	0.0000%	2.1243%	0.0029%
过去三年	9.5303%	0.0051%	4.0537%	0.0000%	5.4766%	0.0051%
过去五年	18.0938%	0.0044%	6.7537%	0.0000%	11.3401%	0.0044%
自基金合同生效 起至今	25.7467%	0.0051%	9.5387%	0.0001%	16.2080%	0.0050%

注：1、本基金收益分配按日结转份额；

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

2. 国联安货币 B:

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0374%	0.0025%	0.3403%	0.0000%	0.6971%	0.0025%
过去六个月	2.1161%	0.0025%	0.6805%	0.0000%	1.4356%	0.0025%
过去一年	3.7231%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	2.3731%	0.0028%
过去三年	10.3242%	0.0051%	4.0537%	0.0000%	6.2705%	0.0051%
过去五年	19.5200%	0.0044%	6.7537%	0.0000%	12.7663%	0.0044%
自基金合同生效 起至今	27.8593%	0.0051%	9.5387%	0.0001%	18.3206%	0.0050%

注：1、本基金收益分配按日结转份额；

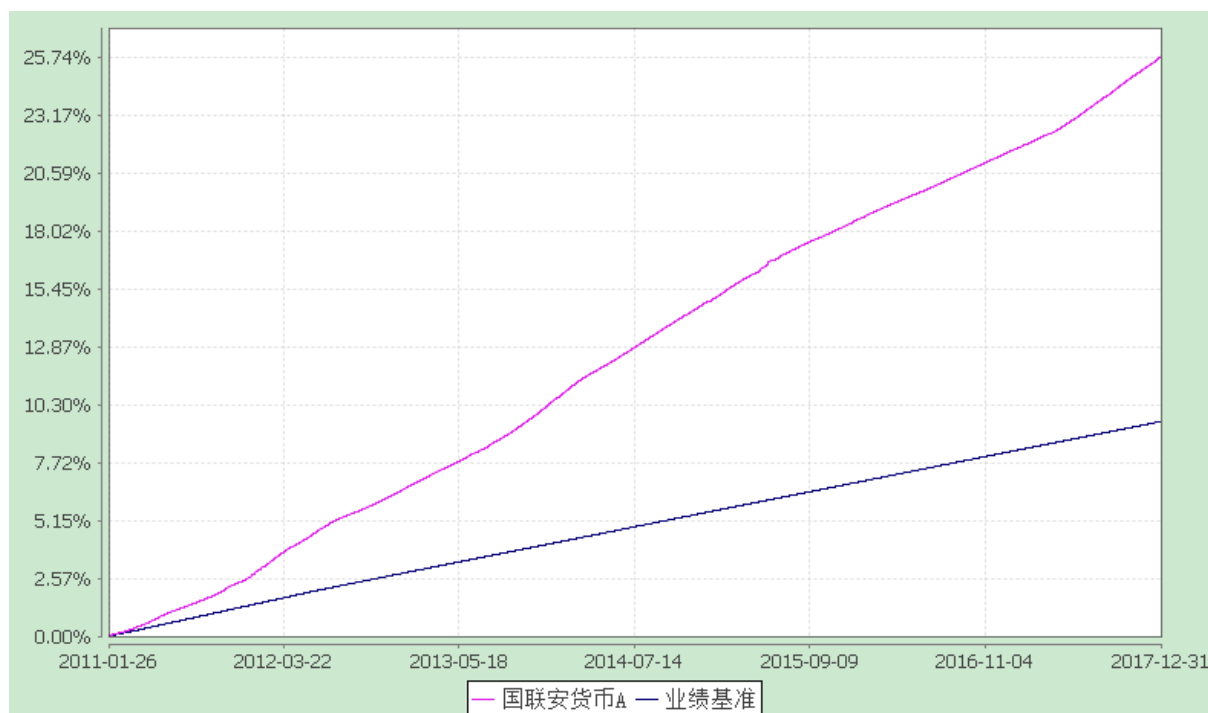
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 1 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日)

1、国联安货币 A

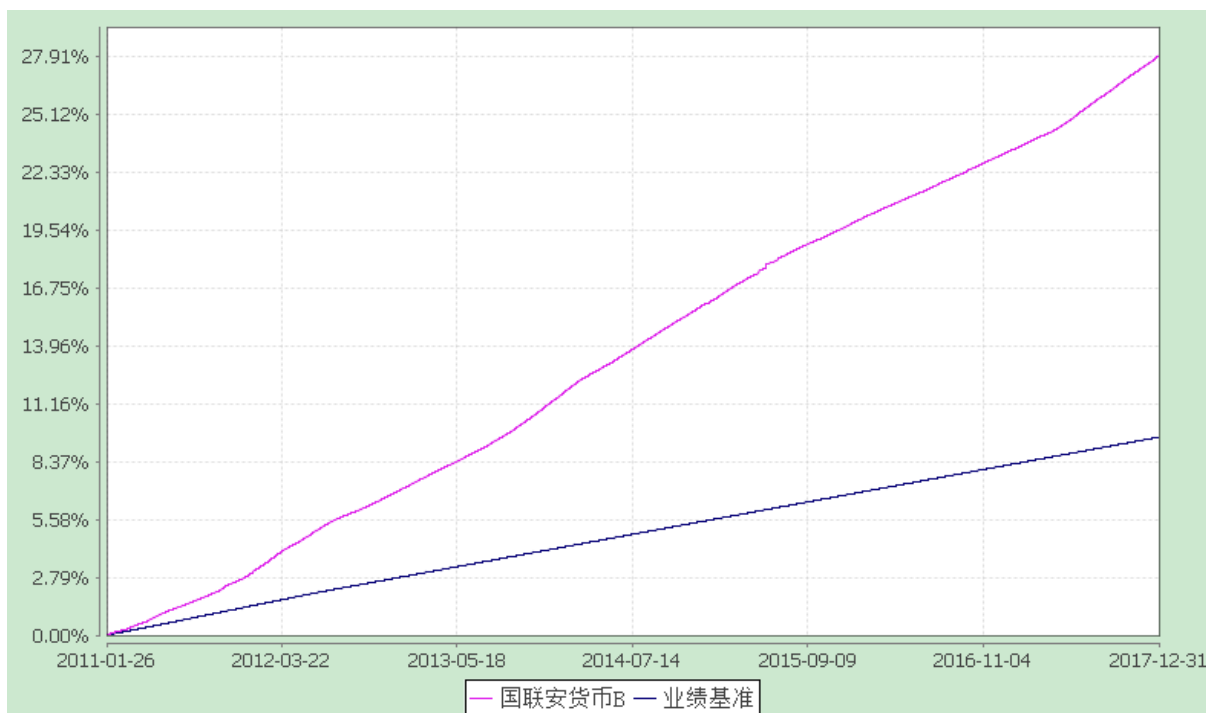


注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

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

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

2、国联安货币 B



注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

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

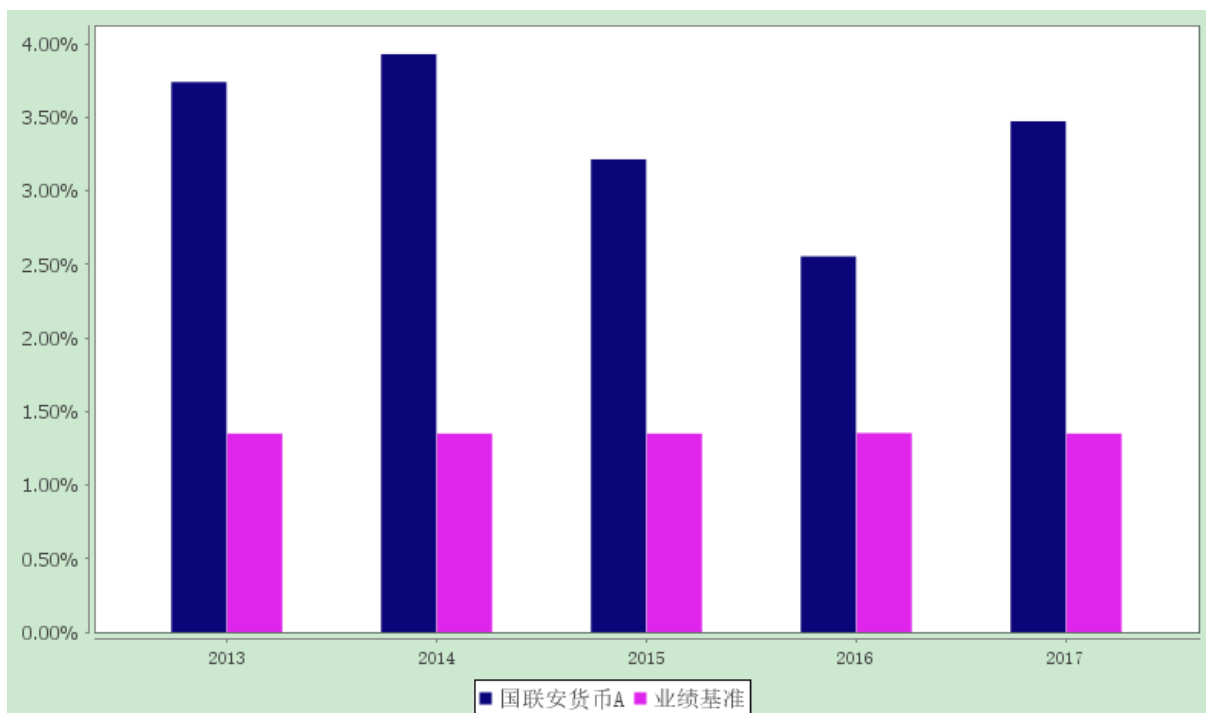
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安货币市场证券投资基金

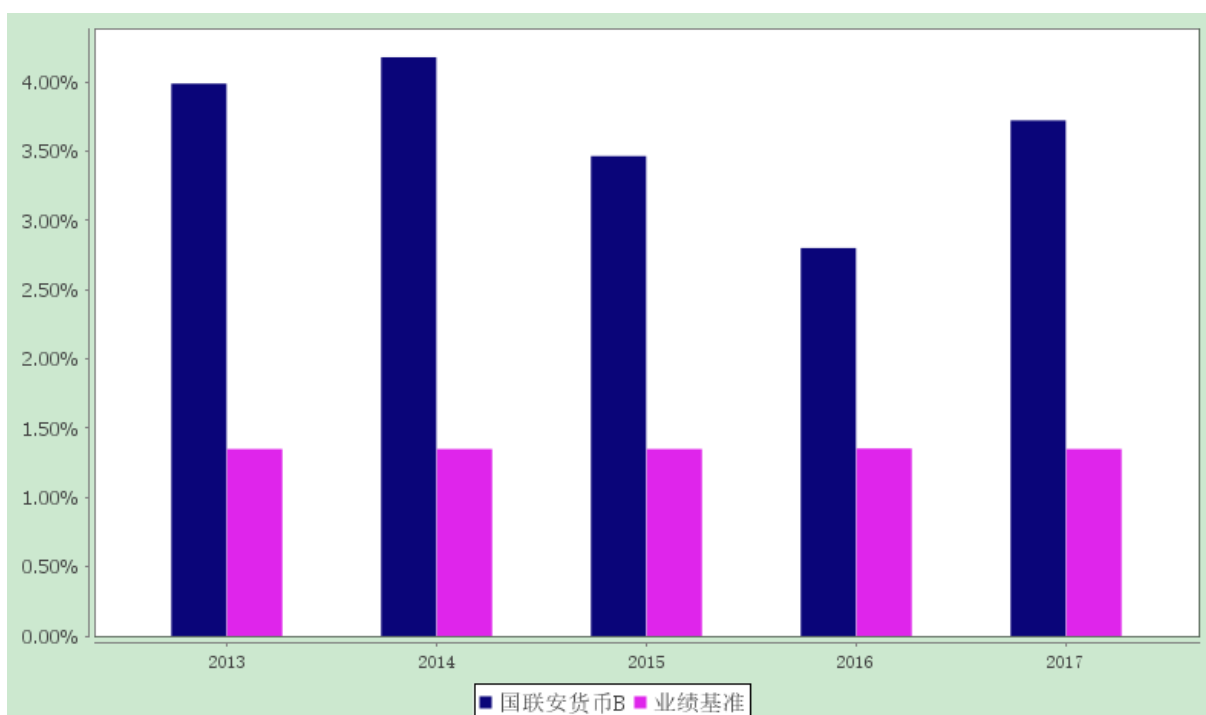
过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1、国联安货币 A



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

2、国联安货币 B



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

国联安货币 A:

单位: 人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2017	3,200,928.75	-	-	3,200,928.75	-
2016	1,457,025.68	-	-	1,457,025.68	-
2015	4,742,575.38	-	-	4,742,575.38	-
合计	9,400,529.81	-	-	9,400,529.81	-

国联安货币 B:

单位: 人民币元

年度	已按再投资 形式转实收 基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合 计	备注
2017	117,476,031. 24	-	-	117,476,031.24	-
2016	383,996,967. 59	-	-	383,996,967.59	-
2015	75,983,657.3 4	-	-	75,983,657.34	-
合计	577,456,656. 17	-	-	577,456,656.17	-

§4 管理人报告**4.1 基金管理人及基金经理情况****4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验**

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司, 其中方股东为国泰君安证券股份有限公司, 是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一; 外方股东为德国安联集团, 是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末, 公司共管理四十只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队, 借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验, 结合本地投资研究与客户服务的成功实践, 秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念, 力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯慧娣	本基金基金经理、兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盛混合型证券投资基金基金经理、国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2015-12-25	-	10 年（自 2007 年）	侯慧娣女士，理学硕士。2006 年 3 月至 2006 年 7 月在国泰君安证券研究所从事国内债券市场数据分析与处理；2006 年 7 月至 2008 年 10 月在世商软件（上海）有限公司从事债券分析；2009 年 12 月至 2012 年 9 月在国信证券股份有限公司经济研究所从事债券和固定收益分析；2012 年 9 月至 2015 年 6 月在德邦基金管理有限公司固定收益部从事研究和管理工作，期间曾担任基金经理和固定收益部副总监。2015 年 6 月加入国联安基金管理有限公司，2015 年 12 月起任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安货币市场证券投资基金基金经理。2016 年 3 月起兼任国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任国联安鑫盛混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月至 2017 年 9 月兼任国联安鑫利混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月起兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。
吕中凡	本基金基金经理助理	2015-07-04	-	6 年（自 2011 年起）	-

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限；

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

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

公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年全年来看，国内宏观经济基本韧性较强，整体好于市场一致预期。PMI 数据虽然有所回落，但一直维持在荣枯线之上。PPI 数据由于受环保限产影响，虽然 4 季度有所回落，回落幅度低于预期。CPI 一直维持在 2% 以下。央行货币政策稳健中性，双支柱特征明显，公开市场更加注重运用“削峰填谷”操作，平滑关键时间节点的流动性。M2 同比增速自 2017 年 5 月份以来一直低于 10%，金融去杠杆效果明显。海外方面，欧洲经济继续复苏，欧央行预计将逐步退出量化宽松，但预期仍不明确；美国经济温和复苏，美联储如期加息三次，但对汇率和外汇占款流出影响不大。

债券市场方面，由于经济基本面整体好于预期，货币政策及金融监管稳健中性，但由于金融去杠杆政策基调贯穿全年，整个银行体系负债压力较大，交易盘情绪脆弱，配置盘无力，二季度和四季度债市调整幅度较大，加上 12 月份银行年底 MPA 考核导致的 12 月下旬资金紧张，债券市场整个 4 季度各期限和评级收益率大幅上行。十年期国开债活跃券上行幅度约 50bp，信用债各等级期限收益率平均上行幅度约 50bp，全年来看利率债和信用债各期限等级平均上行幅度约 100bp，全年熊市特征明显。货币市场方面，由于季末 MPA 考核及银行体系负债压力较大，同业存单发行利率 4 季度上行幅度较大，创 2015 年以来新高，3 个月 AAA 股份制银行存单利率一度上行至 5.4%。

本基金在 2017 年全年继续保持稳健谨慎操作，于季末资金紧张时期择机配置了利率较高的存单、存款和逆回购，保持基金流动性的同时为投资者获取了稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安货币 A 净值收益率为 3.4743%，同期业绩比较基准增长率为 1.3500%。国联安货币 B 净值收益率为 3.7231%，同期业绩比较基准增长率为 1.3500%。

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 2018 年，经济基本面总体呈边际回落趋势，PPI 惯性向下特征明显，通胀虽有压力但由于货币条件较紧，预计整体压力不大。货币政策更加注重双支柱特征，预计将在上半年金融监管和资管细则落地后偏向于关注经济基本面。货币市场利率预计仍然会呈现季节性时点冲高特征，货币政策“削峰填谷”操作预计仍会继续。今年对银行表内流动性监管的新规和资管细则的出台预计会引发融资收紧，中低评级的信用债利差预计大幅走阔，但利率债和高等级信用债将成为高负债压力下的核心资产。货币市场基金将继续保持稳健谨慎操作，于季末资金紧张时期择机配置利率较高的存单、存款和逆回购，保持基金流动性的同时争取为投资者获取稳健的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在内部监察工作中本着一切合法合规运作的指导思想、以保障基金份额持有人利益为宗旨，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司的经营管理、基金的投资运作及员工的行为规范等方面进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门进行整改，并定期制作监察报告报公司管理层。具体来说，报告期内基金管理人的内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 随着相关法律法规的相继公布和实施，监管机构对基金行业的管理也日趋细化和深化。公司对合规经营和风险防范十分重视，为此，公司密切关注监管部门所颁布的各项最新的法律法规，紧跟监管机构的步伐，组织相应部门学习并贯彻落实相应法规。除及时对新进员工进行合规培训外，还在新的法律法规出台时安排了相关法律培训，使员工加深对法律法规及公司规范的理解，力求加强员工的合规意识。

(2) 报告期内，中国证监会进一步明确了依法从严全面监管的政策导向。公司在监管机构的指导下，进一步推动合规经营和风险防范，多次通过邮件和培训等多种形式对公司员工加强教育、引导和监督，并加大了各项稽核力度。

(3) 通过组织各部门认真贯彻落实法规政策、定期自查、监察部门的定期/不定期的抽查，对公司业务的各个方面进行监督检查，包括基金投资、运作、销售等领域，以实现公司的合法合规经营，维护基金份额持有人、公司股东和公司的合法权益。

(4) 加强与托管人的日常联系。监察风控部门分别与托管人的基金日常监督部门加强联系，确定了日常监督的工作方式、业务合作等，并完善日常监督方面的沟通与联系。

基金管理人将继续致力于维护一个有效率、效果的内部控制体系，以风险防范为核心，提高内部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

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金对本报告期内利润分配情况如下，符合本基金基金合同的相关规定。

本基金向本基金 A 级份额持有人共分配利润 3,200,928.75 元，向本基金 B 级份额持有人共分配利润 117,476,031.24 元。

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

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金监督管理办法》、

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

毕马威华振审字第 1800166 号

国联安货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的国联安货币市场证券投资基金（以下简称“国联安货币基金”）财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了国联安货币基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果及基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国联安货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

6.3 其他信息

国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括国联安货币基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结

论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。

在编制财务报表时，国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司管理层负责评估国联安货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非国联安货币基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司治理层负责监督国联安货币基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，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。

(3)评价国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会

计估计及相关披露的合理性。

(4)对国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国联安货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国联安货币基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与国联安货币基金管理人国联安基金管理有限公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所 中国注册会计师

黄小熠 张楠

上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼

2018 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	825,361,658.79	3,418,217,729.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,688,446,626.71	10,236,481,517.02
其中：股票投资		-	-

基金投资		-	-
债券投资	7.4.7.2	2,688,446,626.71	10,236,481,517.02
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,792,328,048.49	3,553,355,148.03
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	17,879,999.15	64,456,123.61
应收股利		-	-
应收申购款		100,028,037.66	67,038,696.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,424,044,370.80	17,339,549,214.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 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		472,409,251.37	195,999,466.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		687,624.11	994.04
应付管理人报酬		784,304.72	3,920,852.58
应付托管费		237,668.08	1,188,137.14
应付销售服务费		51,255.19	134,127.14
应付交易费用	7.4.7.7	84,173.03	170,112.62
应交税费		243,178.08	243,178.08
应付利息		227,706.75	62,365.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	7.4.7.8	301,031.44	17,826,522.09
负债合计		475,026,192.77	219,545,755.52
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	4,949,018,178.03	17,120,003,459.17
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,949,018,178.03	17,120,003,459.17
负债和所有者权益总计		5,424,044,370.80	17,339,549,214.69

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 4,949,018,178.03 份。其中国联安货币 A 份额为 148,874,984.76 份；国联安货币 B 份额为 4,800,143,193.27 份。

7.2 利润表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		150,408,825.48	469,942,392.82
1.利息收入		154,388,867.77	458,088,420.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	42,143,354.36	128,682,065.36
债券利息收入		101,120,720.03	306,922,940.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,124,793.38	22,483,413.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,194,240.58	7,649,907.13
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,194,240.58	7,649,907.13
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-

股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	214,198.29	4,204,065.66
减：二、费用		29,731,865.49	84,488,399.55
1. 管理人报酬		12,276,737.11	46,513,892.00
2. 托管费		3,720,223.32	14,095,118.79
3. 销售服务费		583,471.54	1,547,690.90
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		12,742,894.60	21,885,585.84
其中：卖出回购金融资产支出		12,742,894.60	21,885,585.84
6. 其他费用	7.4.7.19	408,538.92	446,112.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		120,676,959.99	385,453,993.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		120,676,959.99	385,453,993.27

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	17,120,003,459.17	-	17,120,003,459.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	120,676,959.99	120,676,959.99
三、本期基金份额交易产生	-12,170,985,281.14	-	-12,170,985,281.14

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	25,690,426,805.96	-	25,690,426,805.96
2.基金赎回款	-37,861,412,087.10	-	-37,861,412,087.10
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）	-	-120,676,959.99	-120,676,959.99
五、期末所有者权益（基金净值）	4,949,018,178.03	-	4,949,018,178.03
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	10,207,400,036.24	-	10,207,400,036.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	385,453,993.27	385,453,993.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,912,603,422.93	-	6,912,603,422.93
其中：1.基金申购款	86,428,932,502.96	-	86,428,932,502.96
2.基金赎回款	-79,516,329,080.03	-	-79,516,329,080.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-385,453,993.27	-385,453,993.27
五、期末所有者权益（基金净值）	17,120,003,459.17	-	17,120,003,459.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孟朝霞，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况、2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25% 时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25% 以内。当正偏离度绝对值达到 0.5% 时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5% 以内。当负偏离度绝对值达到 0.5% 时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5% 以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5% 时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生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，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。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认列。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，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后

2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资者记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。本基金收益每月集中结转一次。基金管理人正式运作基金资产不满一个月的，不结转。每月结转日，若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额；其累计收益为正值，则增加投资者基金份额。若投资者赎回全部基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资者赎回基金款中扣除。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局

关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

2018 年 1 月 1 日 (含) 以后，资管产品管理人 (以下称管理人) 运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

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

(2) 应交税费

2017 年 12 月 31 日 2016 年 12 月 31 日

债券利息收入所得税 243,178.08 243,178.08

该项是基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

7.4.7 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	11,361,658.79	318,217,729.63
定期存款	814,000,000.00	3,100,000,000.00
其中：存款期限		
1-3 个月	520,000,000.00	1,400,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	294,000,000.00	-
存款期限 1 个月	-	1,700,000,000.00

以内		
其他存款	-	-
合计	825,361,658.79	3,418,217,729.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 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	2,688,446,626.71	2,687,905,000.00	-541,626.71	-0.01
	合计	2,688,446,626.71	2,687,905,000.00	-541,626.71	-0.01
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 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	10,236,481,517.02	10,223,823,816.13	-12,657,700.89	-0.07
	合计	10,236,481,517.02	10,223,823,816.13	-12,657,700.89	-0.07

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2017 年 12 月 31 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），本基金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 2017 年 12 月 31 日

	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	1,792,328,048.49	-
合计	1,792,328,048.49	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	3,553,355,148.03	-
合计	3,553,355,148.03	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2017 年 12 月 31 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	30,042.93	190,989.03
应收定期存款利息	3,964,469.12	3,595,833.38
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	12,462,934.79	59,769,248.82
应收买入返售证券利息	1,422,552.31	900,052.38
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	17,879,999.15	64,456,123.61

7.4.7.6 其他资产

本报告期末（2017 年 12 月 31 日）及上年度末（2016 年 12 月 31 日），本基金未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	84,173.03	170,112.62
合计	84,173.03	170,112.62

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,031.44	5.96
其他应付款	1,000.00	17,527,516.13
预提帐户维护费	9,000.00	9,000.00
银行手续费	-	-
预提审计费	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	220,000.00	220,000.00
合计	301,031.44	17,826,522.09

7.4.7.9 实收基金

国联安货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	126,067,103.28	126,067,103.28
本期申购	603,732,263.55	603,732,263.55
本期赎回（以“-”号填列）	-580,924,382.07	-580,924,382.07
本期末	148,874,984.76	148,874,984.76

注：总申购份额含基金份额级别调整和转换入份额，总赎回份额包含基金份额级别调整和转换出份额。

国联安货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,993,936,355.89	16,993,936,355.89
本期申购	25,086,694,542.41	25,086,694,542.41
本期赎回（以“-”号填列）	-37,280,487,705.03	-37,280,487,705.03
本期末	4,800,143,193.27	4,800,143,193.27

注：总申购份额含基金份额级别调整和转换入份额，总赎回份额包含基金份额级别调整和转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

国联安货币 A

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
本期利润	3,200,928.75	-	3,200,928.75
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	-3,200,928.75	-	-3,200,928.75
本期末	-	-	-

国联安货币 B

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
本期利润	117,476,031.24	-	117,476,031.24
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	-117,476,031.24	-	-117,476,031.24
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	2,181,097.13	4,445,830.50
定期存款利息收入	39,957,385.23	124,231,204.88
其他存款利息收入	0.00	0.00
结算备付金利息收入	4,872.00	5,029.98
其他	0.00	0.00
合计	42,143,354.36	128,682,065.36

注：此处其他列示的是基金认申购款滞留利息。

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益。

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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1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	-4,194,240.58	7,649,907.13
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	-4,194,240.58	7,649,907.13

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月 31日	2016年1月1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	24,697,390,825.36	40,728,180,232.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,602,346,820.28	40,454,880,995.50
减：应收利息总额	99,238,245.66	265,649,329.69
买卖债券差价收入	-4,194,240.58	7,649,907.13

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券赎回价差收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券申购价差收入。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	214,198.29	4,204,065.66
合计	214,198.29	4,204,065.66

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内及上年度可比期间均无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	220,000.00	220,000.00
银行汇划费用	81,138.92	116,512.02
债券帐户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,400.00	3,600.00
合计	408,538.92	446,112.02

注：此处其他列示的是上清所费用。

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
国联安基金管理有限公司	基金管理人
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司(“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司
国联安-华融-定增5号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安海天稳健1号特定客户资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金公司-工行一至和定向增发20号	基金管理人管理的专户产品
国联安-龙韵1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-齐瑞管理1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，基金无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，基金无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，基金无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	810,000,000.00	100.00%	570,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内与上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,276,737.11	46,513,892.00

其中：支付销售机构的客户 维护费	443,490.24	238,243.48
---------------------	------------	------------

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

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,720,223.32	14,095,118.79

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

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安货币 A	国联安货币 B	合计
浦发银行	8,030.11	8.22	8,038.33
国泰君安	6,124.72	416.91	6,541.63
国联安基金管理有限公司	37,490.52	343,792.97	381,283.49
合计	51,645.35	344,218.10	395,863.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年12月31日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安货币A	国联安货币B	合计
浦发银行	8,894.37	5.39	8,899.76
国泰君安	4,712.00	1,464.40	6,176.40
国联安基金管理有限 公司	46,088.73	1,368,680.44	1,414,769.17
合计	59,695.10	1,370,150.23	1,429,845.33

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

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	-	99,781,338.71	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

国泰君安	-	-	504,750,000.00	516,713.69	347,000,000.00	61,692.68
浦发银行	-	-	-	-	1,395,800,000.00	158,907.21

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B
期初持有的基金份额	-	377,054,937.76	-	372,478,033.08
期间申购/买入总份额	-	-	-	150,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	11,531,168.10	-	9,576,904.68
减：期间赎回/卖出总份额	-	85,000,000.00	-	155,000,000.00
期末持有的基金份额	-	303,586,105.86	-	377,054,937.76
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.32%	-	2.22%

7.4.10.4.2 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

国联安货币 A

份额单位：份

关联方名称	国联安货币A本期末 2017年12月31日		国联安货币A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

		比例		
国联安海天稳健 1 号特定客户资产管理计划	-	-	362,772.46	0.29%
国联安基金公司一工行一至和定向增发 20 号	4,651,156.15	3.12%	-	-
国联安一齐瑞管理 1 号资产管理计划	4,690,356.13	3.15%	-	-

国联安货币 B

份额单位：份

关联方名称	国联安货币B本期末 2017年12月31日		国联安货币B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
中德安联	28,532,742.63	0.59%	89,734,411.33	0.53%
国泰君安	-	-	197,459,823.47	1.16%
国联安-华融-定增 5 号资产管理计划	-	-	7,619,527.93	0.04%
国联安一龙韵 1 号资产管理计划	13,000,000.00	0.27%	-	-

7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	111,361,658.79	13,972,055.36	2,718,217,729.63	18,102,997.39

注：本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2017 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 0 元。于 2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 0 元

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内与上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内与上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

1、国联安货币 A

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
3,200,928.75	-	-	3,200,928.75	-

2、国联安货币 B

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
117,476,031.24	-	-	117,476,031. 24	-

7.4.12 期末（2017 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和增发而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 472,409,251.37 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
111786034	17 富邦华一	2018-01-02	98.68	368,000.00	36,314,240.00

	银行				
111710635	17 兴业银行 CD635	2018-01-02	99.08	885,000.00	87,685,800.00
111785726	17 成都农商 银行 CD045	2018-01-02	98.78	320,000.00	31,609,600.00
111785726	17 成都农商 银行 CD045	2018-01-02	98.78	52,000.00	5,136,560.00
111785726	17 成都农商 银行 CD045	2018-01-02	98.78	111,000.00	10,964,580.00
150201	15 国开 01	2018-01-02	99.99	1,050,000.00	104,989,500.00
150201	15 国开 01	2018-01-02	99.99	750,000.00	74,992,500.00
170204	17 国开 04	2018-01-02	99.80	500,000.00	49,900,000.00
150207	15 国开 07	2018-01-02	99.94	200,000.00	19,988,000.00
111772266	17 郑州银行 CD221	2018-01-02	97.49	698,000.00	68,048,020.00
合计				4,934,000.00	489,628,800.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金基金管理人的风险控制组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营

中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

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等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年末 2016年12月31日
A-1	-	529,594,796.88
A-1 以下	-	-
未评级	2,438,532,952.35	9,105,576,612.17
合计	2,438,532,952.35	9,635,171,409.05

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资；

2、本报告期末及上年度末，未评级的短期信用债券均是超短期融资债券和同业存单。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期信用债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，建立流动性风险监控与预警机制，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。本基金所持大部分证券均能及时变现，能够通过出售所持有的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及同业存单应对流动性需求。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30% 以上的情形外，债券正回购的资金余额不主动超过基金资产净值的 20%。

本基金的投资范围包括：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外。本基金管理人根据份额持有人集中度情况对本基金的投资组合实施调整，针对不同档位的份额持有人集中度设定不同的指标要求，包括：投资组合的平均剩余期限；投资组合的平均剩余存续期；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计。

本报告期末，本基金的前 10 名份额持有人持有份额合计超过本基金总份额的 50%，本基金投资组合的平均剩余期限未超过 60 天，平均剩余存续期未超过 120 天，投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占本基金资产净值的比例合计高于 30%。本报告期末，本基金投资于流动性受限资产的市值合计未超过本基金资产净值的 10%。本报告期末，本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券等金融工具占本基金资产净值的比例合计未超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占本基金资产净值的比例合计未超过 2%。本报告期末，本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，未超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金管理人所管理采用摊余成本法进行核算的货币市场基金的月末资产净值合计未超过本基金管理人风险准备金月末余额的 200 倍。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 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	325,361,65 8.79	500,000,00 0.00	-	-	-	-	825,361,65 8.79
结算备付金	-	-	-	-	-	-	0.00
存出保证金	-	-	-	-	-	-	0.00
交易性金融资产	719,353,84 2.53	1,753,727,6 28.45	215,365,15 5.73	-	-	-	2,688,446,6 26.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	1,792,328,0 48.49	-	-	-	-	-	1,792,328,0 48.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	17,879,999. 15	17,879,999. 15
应收申购款	-	-	-	-	-	100,028,03 7.66	100,028,03 7.66
其他资产	-	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	-	0.00
-	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	2,837,043,5 49.81	2,253,727,6 28.45	215,365,15 5.73	0.00	0.00	117,908,03 6.81	5,424,044,3 70.80

负债							
卖出回购金融资产款	472,409,25 1.37	-	-	-	-	-	472,409,25 1.37
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	687,624.11	687,624.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	784,304.72	784,304.72
应付托管费	-	-	-	-	-	237,668.08	237,668.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	51,255.19	51,255.19
应付交易费用	-	-	-	-	-	84,173.03	84,173.03
应付税费	-	-	-	-	-	243,178.08	243,178.08
应付利息	-	-	-	-	-	227,706.75	227,706.75
其他负债	-	-	-	-	-	301,031.44	301,031.44
负债总计	472,409,25 1.37	0.00	0.00	0.00	0.00	2,616,941.4 0	475,026,19 2.77
利率敏感度缺口	2,364,634,2 98.44	2,253,727,6 28.45	215,365,15 5.73	0.00	0.00	115,291,09 5.41	4,949,018,1 78.03
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	2,018,217,7 29.63	1,400,000,0 00.00	-	-	-	-	3,418,217,7 29.63
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,129,666,2 41.28	3,378,423,0 83.33	5,728,392,1 92.41	-	-	-	10,236,481, 517.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,553,355,1 48.03	-	-	-	-	-	3,553,355,1 48.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	64,456,123. 61	64,456,123. 61
应收申购款	-	-	-	-	-	67,038,696. 40	67,038,696. 40

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,701,239.1 18.94	4,778,423.0 83.33	5,728,392.1 92.41	0.00	0.00	131,494.82 0.01	17,339,549. 214.69
负债							
卖出回购金融资产款	195,999.46 6.00	-	-	-	-	-	195,999.46 6.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	994.04	994.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,920,852.5 8	3,920,852.5 8
应付托管费	-	-	-	-	-	1,188,137.1 4	1,188,137.1 4
应付销售服务费	-	-	-	-	-	134,127.14	134,127.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	170,112.62	170,112.62
应付税费	-	-	-	-	-	243,178.08	243,178.08
应付利息	-	-	-	-	-	62,365.83	62,365.83
其他负债	-	-	-	-	-	17,826,522. 09	17,826,522. 09
负债总计	195,999.46 6.00	0.00	0.00	0.00	0.00	23,546,289. 52	219,545,75 5.52
利率敏感度缺口	6,505,239.6 52.94	4,778,423.0 83.33	5,728,392.1 92.41	0.00	0.00	107,948.53 0.49	17,120,003. 459.17

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加 1,174,887.59	增加 7,710,389.56
	市场利率上升 25 个基点	减少 1,174,887.59	减少 7,710,389.56

注：本报告期末及上年度末，在市场利率变化 25 个基点的假设下，本基金的影子定价偏离度绝

对值均未超过 0.25%。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，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，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,687,905,000.00	54.31	10,236,481,517.02	59.79
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,687,905,000.00	54.31	10,236,481,517.02	59.79

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	2,688,446,626.71	49.57
	其中：债券	2,688,446,626.71	49.57
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,792,328,048.49	33.04
	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	825,361,658.79	15.22
4	其他各项资产	117,908,036.81	2.17
5	合计	5,424,044,370.80	100.00

8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	12.56	
	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	472,409,251.37	9.55
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2017-03-23	24.03	大额赎回	1 个交易日

2	2017-04-19	25.53	大额赎回	1 个交易日
3	2017-06-12	21.97	大额赎回	1 个交易日
4	2017-06-27	24.14	大额赎回	1 个交易日
5	2017-07-25	33.23	大额赎回	1 个交易日
6	2017-08-18	25.47	大额赎回	1 个交易日
7	2017-08-22	39.06	大额赎回	1 个交易日
8	2017-08-28	27.06	大额赎回	1 个交易日
9	2017-08-31	27.19	大额赎回	1 个交易日
10	2017-09-01	27.89	大额赎回	1 个交易日
11	2017-11-28	39.04	大额赎回	1 个交易日

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	51.32	9.55
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	38.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	3.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
	合计	107.22	9.55

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	249,913,674.36	5.05
	其中：政策性金融债	249,913,674.36	5.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	260,274,134.91	5.26
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,178,258,817.44	44.01
8	其他	-	-
9	合计	2,688,446,626.71	54.32
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111709493	17 浦发银行 CD493	3,000,000	297,154,748.53	6.00
2	111715507	17 民生银行 CD507	2,000,000	197,459,041.12	3.99
3	150201	15 国开 01	1,800,000	180,011,839.31	3.64
4	011754141	17 平安租赁 SCP009	1,000,000	100,165,474.42	2.02
5	111712221	17 北京银行 CD221	1,000,000	99,815,166.98	2.02
6	111786580	17 杭州银行 CD205	1,000,000	99,801,979.50	2.02
7	111712236	17 北京银行 CD236	1,000,000	99,715,582.31	2.01
8	111708381	17 中信银行 CD381	1,000,000	99,458,847.87	2.01

9	111708386	17 中信银行 CD386	1,000,000	99,433,192.82	2.01
10	111710582	17 兴业银行 CD582	1,000,000	99,433,192.82	2.01

8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	13 次
报告期内偏离度的最高值	0.49%
报告期内偏离度的最低值	-0.04%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.06%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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

8.9.2 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除 17 浦发银行 CD493 和 17 民生银行 CD507 外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

17 浦发银行 CD493（111709493）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司呼和浩特分行由于违规转让非不良贷款于 2017 年 3 月 29 日被中国银监会处以罚款 20 万元。

17 民生银行 CD507（111715507）的发行主体中国民生银行股份有限公司由于（1）批量转让个人贷款、安排回购条件以及未按规定进行信息披露（2）违规转让非不良贷款于 2017 年 3 月 29 日被中国银监会处以罚款共计 70 万元。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	17,879,999.15
4	应收申购款	100,028,037.66
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	117,908,036.81

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国联安货币 A	6,069	24,530.40	19,384,380.51	13.02%	129,490,604.25	86.98%
国联安货币 B	73	65,755,386.21	4,529,826,944.01	94.37%	270,316,249.26	5.63%
合计	6,142	805,766.55	4,549,211,324.52	91.92%	399,806,853.51	8.08%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,000,799,927.47	20.24%
2	券商类机构	502,772,290.22	10.17%
3	基金类机构	303,900,021.06	6.15%

4	保险类机构	300,186,653.63	6.07%
5	银行类机构	300,280,348.59	6.07%
6	券商类机构	200,620,738.49	4.06%
7	券商类机构	200,113,166.27	4.05%
8	券商类机构	101,001,375.98	2.04%
9	基金类机构	100,698,824.33	2.04%
10	券商类机构	100,132,663.45	2.03%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安货币 A	1,768,678.32	1.19%
	国联安货币 B	0.00	0.00%
	合计	1,768,678.32	0.04%

9.4 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

项目	份额级别	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	国联安货币 A	50~100
	国联安货币 B	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安货币 A	0
	国联安货币 B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安货币 A	国联安货币 B
基金合同生效日（2011 年 1 月 26 日） 基金份额总额	1,418,735,986.38	1,427,051,241.81
本报告期期初基金份额总额	126,067,103.28	16,993,936,355.89
本报告期基金总申购份额	603,732,263.55	25,086,694,542.41
减：本报告期基金总赎回份额	580,924,382.07	37,280,487,705.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	148,874,984.76	4,800,143,193.27
-------------	----------------	------------------

注：

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

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.2017 年 9 月 5 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。孟朝霞女士担任国联安基金管理有限公司总经理，谭晓雨女士不再担任国联安基金管理有限公司总经理。

2.本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1.本报告期内，中国证券监督管理委员会上海监管局对本基金管理人进行了现场检查，并就检查中发现的问题下发了《关于对国联安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。对此，我司高度重视，对相关制度流程进行了全面梳理，针对性的制定了整改执行方案，逐条落实，彻底排查了业务中存在的风险，并就整改情况向中国证券监督管理委员会上海监管局提交了整改报告。

2.本报告期托管人及其高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

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率	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、 专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

A 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于 3 亿元人民币。

B 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范, 近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格, 具备健全的内部控制制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求, 并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

A 提供的研究报告质量和数量;

B 研究报告被基金采纳的情况;

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;

E 由基金管理人提出课题, 证券经营机构提供的研究论文质量;

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名, 同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留, 并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出

基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	810,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持海兰信股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-14
2	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持国药股份和麦捷科技股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-18
3	国联安货币市场证券投资基金于 2017 年“春节”假期前一日暂停申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-26
4	国联安基金管理有限公司关于开展网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-26
5	国联安基金管理有限公司关于增加贵州华阳众惠基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-02-10
6	国联安基金管理有限公司关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-02-10

	加费率优惠的公告		
7	国联安货币市场证券投资基金四季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-21
8	国联安货币市场证券投资基金于 2017 年“春节”假期前一日暂停申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-26
9	国联安货币市场证券投资基金招募说明书(更新)	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-11
10	国联安基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-23
11	国联安货币市场证券投资基金 2016 年年报	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-28
12	国联安货币市场证券投资基金于 2017 年“清明”假期前两日暂停申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-31
13	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持康尼机电股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-13
14	国联安货币市场证券投资基金 2017 年一季度报告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-22
15	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宣亚国际股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-26
16	国联安货币市场证券投资基金于 2017 年“五一”劳动节假期前一日暂停申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-28
17	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华铭智能股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-25
18	国联安货币市场证券投资基金于 2017 年“端午”假期前两日暂停申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-26
19	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加武汉市伯嘉基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-01
20	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万盛股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-03
21	国联安基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-16
22	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持索菱股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-22
23	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持乐视网股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-07-15
24	国联安货币市场证券投资基金 2 季报	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-07-19

25	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-01
26	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持八一钢铁、沙钢股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-02
27	关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-08
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中粮地产股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-12
29	国联安基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通申购、赎回及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-17
30	国联安货币市场证券投资基金半年报	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-25
31	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-08-28
32	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-09-05
33	国联安货币市场证券投资基金招募说明书(更新)	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-09-08
34	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中国铝业股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-09-16
35	国联安货币市场证券投资基金于 2017 年“国庆节”假期前三日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-09-28
36	国联安货币市场证券投资基金 3 季报	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-10-27
37	国联安基金管理有限公司关于开展网上直销基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-11-11
38	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持乐视网股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-11-18
39	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加弘业期货股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-01
40	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持亨通光电股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-07
41	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持涪陵榨菜股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-15
42	国联安基金管理有限公司关于恢复国联安货币市场证券投资基金网上直销“T+0 快速取现”服务的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-16

43	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业证券股份有限公司为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-22
44	国联安基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-23
45	国联安货币市场证券投资基金于 2018 年“元旦”假期前一日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-27
46	国联安基金关于旗下基金及专户产品实施增值税政策的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-12-30

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2017年1月4日至2017年12月31日	3,000,921.74	2,260,709.56	4,261,631,303.60	1,000,000,000.00	20.21%
	2	2017年11月28日至2017年12月20日	0.00	1,502,252.94	1,000,000,000.00	502,252,948.80	10.16%
	3	2017年4月19日至2017年9月26日	377,054,937.80	11,531,168.10	85,000,000.00	303,586,105.90	6.14%
	4	2017年1月24日至2017年4月7日	1,500,000.00	9,830,420.96	1,509,830,420.96	0.00	0.00%
	5	2017年8月4日至2017年10月31日	0.00	1,501,561.20	1,501,561,203.07	0.00	0.00%
	6	2017年4月28日至2017年6月26日	0.00	784,103,772.22	784,103,772.22	0.00	0.00%
	7	2017年3月2日至2017年3月22日	0.00	1,003,408,316.76	1,003,408,316.76	0.00	0.00%
	8	2017年4月18日	0.00	500,000,000.00	500,000,000.00	0.00	0.00%
	9	2017年8月16日	0.00	1,001,000.00	1,001,000.00	0.00	0.00%

		至 2017 年 8 月 30 日		077, 44 2. 39	7, 442. 39		
	10	2017 年 5 月 24 日	0. 00	1, 003, 509, 45 7. 46	1, 001, 76 4, 739. 00	1, 744, 718. 8 6	0. 04%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安货币市场证券投资基金发行及募集的文件
- 2、国联安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照及公司章程
- 3、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》
- 4、《国联安货币市场证券投资基金托管协议》
- 5、国联安货币市场证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

13.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日