

国寿安保聚宝盆货币市场基金 2018 年年度报告(摘要)

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：徽商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 30 日

§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。

基金托管人徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------|
| 基金名称 | 国寿安保聚宝盆货币市场基金 |
| 基金简称 | 国寿安保聚宝盆货币 |
| 基金主代码 | 001096 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 3 月 2 日 |
| 基金管理人 | 国寿安保基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 徽商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,016,341,669.92 份 |

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 | 徽商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张彬 | 刘国君 |
| | 联系电话 | 010-50850744 | 0551-65970489 |
| | 电子邮箱 | public@gsfunds.com.cn | liuguojun@hsbank.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4009-258-258 | 40088-96588 |
| 传真 | | 010-50850776 | 0551-62667787 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号 | 中国安徽省合肥市安庆路 79 号 天徽大厦 A 座 |
| 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 | 中国安徽省合肥市安庆路 79 号 天徽大厦 A 座 |
| 邮政编码 | | 100033 | 230001 |
| 法定代表人 | | 王军辉 | 吴学民 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gsfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|----|----|------|
|----|----|------|

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2018 年 | 2017 年 | 2016 年 |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 128,763,853.64 | 133,565,083.83 | 44,062,930.23 |
| 本期利润 | 128,763,853.64 | 133,565,083.83 | 44,062,930.23 |
| 本期净值收益率 | 3.9805% | 4.0036% | 2.8107% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 期末基金资产净值 | 2,016,341,669.92 | 3,794,934,947.84 | 1,939,151,193.41 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2018 年末 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 累计净值收益率 | 14.8536% | 10.4568% | 6.2048% |

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。

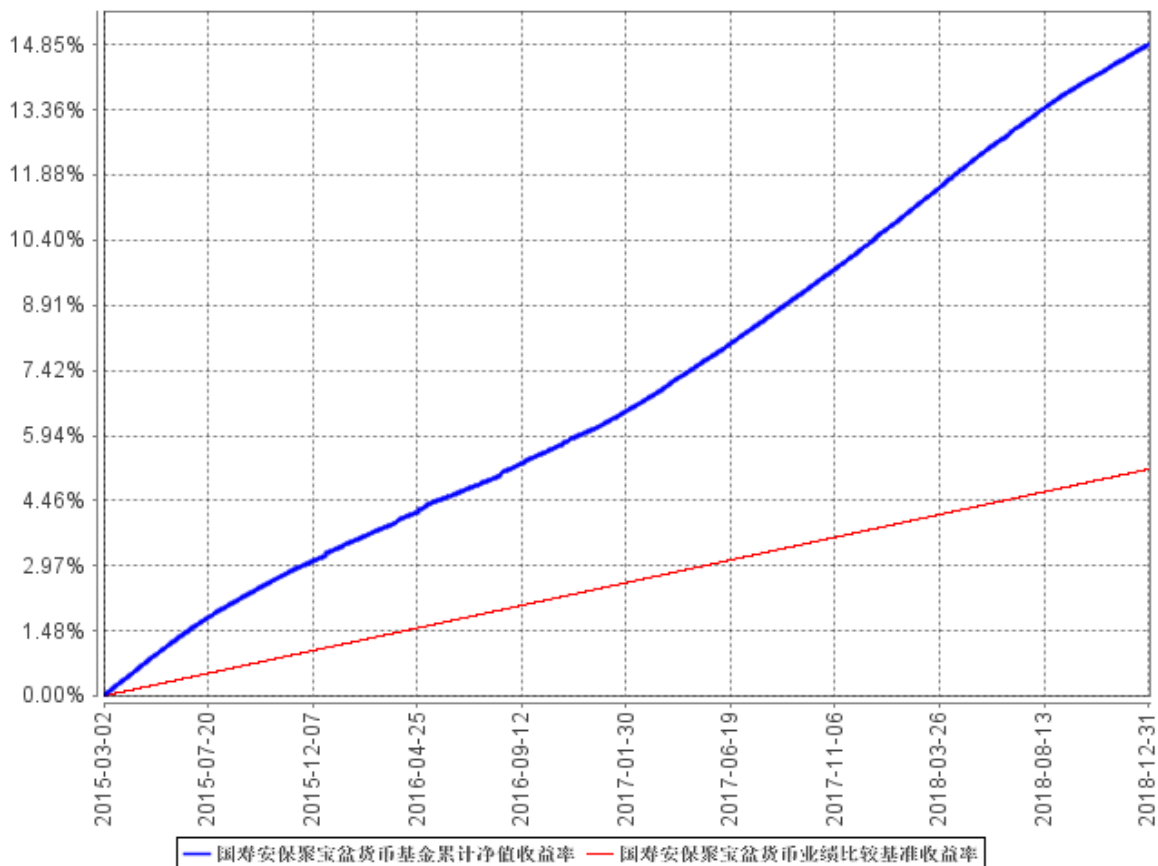
3.2 基金净值表现

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.8050% | 0.0005% | 0.3403% | 0.0000% | 0.4647% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 1.7684% | 0.0011% | 0.6805% | 0.0000% | 1.0879% | 0.0011% |
| 过去一年 | 3.9805% | 0.0016% | 1.3500% | 0.0000% | 2.6305% | 0.0016% |
| 过去三年 | 11.1831% | 0.0031% | 4.0500% | 0.0000% | 7.1331% | 0.0031% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.8536% | 0.0032% | 5.1781% | 0.0000% | 9.6755% | 0.0032% |

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

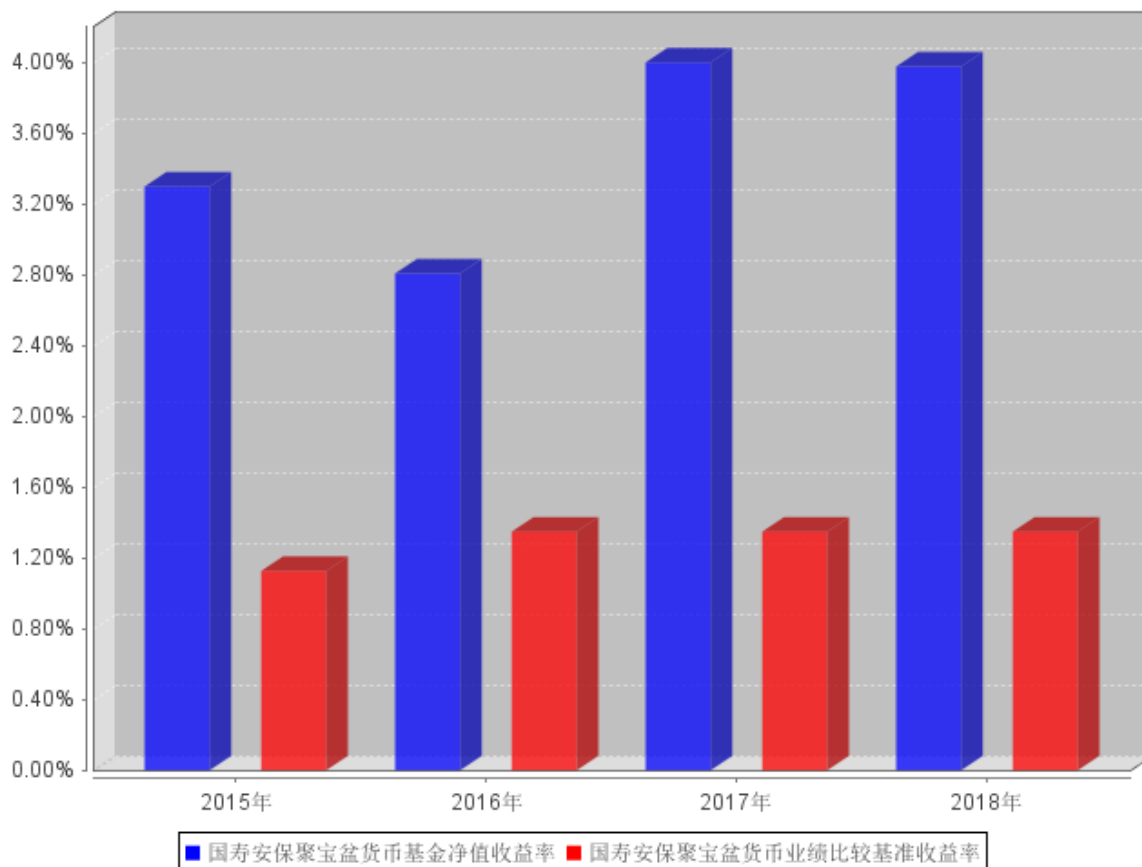
国寿安保聚宝盆货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于 2015 年 3 月 2 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 3 月 2 日至 2018 年 12 月 31 日。

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

国寿安保聚宝盆货币自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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 |
|------|------------------|-------------------|---------------|----------------|----|
| 2018 | 129,797,523.86 | - | -1,033,670.22 | 128,763,853.64 | |
| 2017 | 132,261,439.50 | - | 1,303,644.33 | 133,565,083.83 | |
| 2016 | 43,801,316.72 | - | 261,613.51 | 44,062,930.23 | |
| 合计 | 305,860,280.08 | - | 531,587.62 | 306,391,867.70 | |

§ 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 12.88 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 2018 年 12 月 31 日，公司共管理 43 只公募基金和部分资产管理计划，公司管理资产总规模为 2017.49 亿元，其中公募基金管理规模 1570.15 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 | | |
| 桑迎 | 基金经理 | 2015 年 3 月 2 日 | - | 16 年 | 硕士研究生。 2002 年 7 月至 2003 年 8 月，任职于交通银行北京分行，担任交易员； 2004 年 11 月至 2008 年 1 月，任职于华夏银行总行资金部，担任交易员； 2008 年 2 月至 2013 年 12 月，任职于嘉实基金，历任交易员、基金经理。2013 年 12 月加入国寿安保基金管理有限公司，现任国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保聚宝盆货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金及国寿安保货币市场基金基金经理。 |

| | | | | | |
|----|------|-------------------|---|-----|---|
| 张英 | 基金经理 | 2017 年 1 月 5 日 | - | 6 年 | 曾任中国人寿资产管理有限公司国际部研究员。2013 年加入国寿安保基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。现任国寿安保聚宝盆货币市场基金及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或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年国内宏观经济整体较为平稳，体现出较强的韧性。年初在基建带动下，工业增加值和固定资产投资保持较高水平。二季度之后资管新规执行，表外融资转向表内，但表外急剧收缩带来社融增速下行，实体经济融资难度增大；棚改政策边际转弱，叠加城投债、非标等融资收缩，基建投资增速下滑；贸易战逐步发酵，金融市场风险偏好下降。全年央行主要通过 MLF、降准和定向降准等方式投放中长期流动性：全年降准四次，合计 3 个百分点，置换到期 MLF 和补充由于财税上缴、存款准备金上缴等方式回收的流动性，银行间市场利率逐步下降，四季度银存间质押式回购利率 DR001 均值降至 2.37%，DR007 均值降至 2.63%。

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，2018 年全年稳健操作，以投资价值较高的同业存款和存单为主，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 3.9805%，业绩比较基准收益率为 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

四季度以来国内部分经济指标出现较强的边际走弱信号，包括基建投资、房地产投资、消费、进出口和融资需求等，2019 年宏观经济尤其是上半年将面临较大下行压力。外部环境来看，美国国内也面临减税效果边际减弱、房地产市场走弱的压力，联储态度偏鸽派，外部环境的宽松将为国内货币政策打开空间。我们认为 2019 年货币政策将强化逆周期调节，央行将继续通过降准等工具释放中长期流动性，银行间市场流动性总体将继续维持合理充裕水平。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续

续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、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债金融估值中心有限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在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金采用 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 128,763,853.64 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，徽商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国寿安保聚宝盆货币基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告已经安永华明会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者欲了解审计报告详细内容，可通过登载于国寿安保基金管理有限公司网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保聚宝盆货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 631,714,719.58 | 1,520,092,830.70 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 1,580,491,239.92 | 1,735,954,719.33 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,580,491,239.92 | 1,735,954,719.33 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | 839,914,179.87 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 7,481,550.27 | 14,375,482.11 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 2,219,687,509.77 | 4,110,337,212.01 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 201,041,378.44 | 311,299,333.05 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 463,824.19 | 773,523.64 |
| 应付托管费 | 185,529.69 | 309,409.41 |
| 应付销售服务费 | 278,294.55 | 464,114.15 |
| 应付交易费用 | 29,024.93 | 40,566.67 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | 148,162.02 | 282,021.00 |

| | | |
|---------------|------------------|------------------|
| 应付利润 | 627,626.03 | 1,661,296.25 |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 572,000.00 | 572,000.00 |
| 负债合计 | 203,345,839.85 | 315,402,264.17 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 2,016,341,669.92 | 3,794,934,947.84 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 2,016,341,669.92 | 3,794,934,947.84 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,219,687,509.77 | 4,110,337,212.01 |

注: 报告截止日 2018 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.00 元, 基金份额总额 2,016,341,669.92 份。

7.2 利润表

会计主体: 国寿安保聚宝盆货币市场基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-------------------------|---|--|
| 一、收入 | 150,864,396.56 | 153,726,919.78 |
| 1. 利息收入 | 150,116,711.96 | 153,668,394.90 |
| 其中: 存款利息收入 | 61,302,692.35 | 81,762,805.93 |
| 债券利息收入 | 80,912,269.72 | 49,487,711.42 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 7,901,749.89 | 22,417,877.55 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益 (损失以“-”填列) | 747,684.60 | 58,524.88 |
| 其中: 股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 747,684.60 | 58,524.88 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列) | - | - |
| 4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列) | - | - |
| 5. 其他收入 (损失以“-”号填列) | - | - |
| 减: 二、费用 | 22,100,542.92 | 20,161,835.95 |
| 1. 管理人报酬 | 8,078,583.84 | 8,395,508.39 |

| | | |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 2. 托管费 | 3,231,433.62 | 3,358,203.19 |
| 3. 销售服务费 | 4,847,150.37 | 5,037,305.06 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 5,525,975.09 | 2,953,419.31 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | 5,525,975.09 | 2,953,419.31 |
| 6. 税金及附加 | - | - |
| 7. 其他费用 | 417,400.00 | 417,400.00 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | 128,763,853.64 | 133,565,083.83 |
| 减: 所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | 128,763,853.64 | 133,565,083.83 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 国寿安保聚宝盆货币市场基金

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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) | 3,794,934,947.84 | - | 3,794,934,947.84 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 128,763,853.64 | 128,763,853.64 |
| 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) | -1,778,593,277.92 | - | -1,778,593,277.92 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 15,837,132,360.85 | - | 15,837,132,360.85 |
| 2. 基金赎回款 | -17,615,725,638.77 | - | -17,615,725,638.77 |
| 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) | - | -128,763,853.64 | -128,763,853.64 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,016,341,669.92 | - | 2,016,341,669.92 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 1,939,151,193.41 | - | 1,939,151,193.41 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 133,565,083.83 | 133,565,083.83 |
| 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） | 1,855,783,754.43 | - | 1,855,783,754.43 |
| 其中：1. 基金申购款 | 34,361,649,488.50 | - | 34,361,649,488.50 |
| 2. 基金赎回款 | -32,505,865,734.07 | - | -32,505,865,734.07 |
| 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） | - | -133,565,083.83 | -133,565,083.83 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,794,934,947.84 | - | 3,794,934,947.84 |

报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保聚宝盆货币市场基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可 2015 226 号文《关于准予国寿安保聚宝盆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（简称“国寿安保”）于 2015 年 2 月 26 日至 2015 年 2 月 27 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_A02 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 3 月 2 日正式生效，首次设立募集规模为 258,294,341.88 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，基金托管人为徽商银行股份有限公司（简称“徽商银行”）。

根据基金管理人国寿安保于 2016 年 09 月 02 日发布的《国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保聚宝盆货币市场基金修改基金合同及托管协议的公告》，本基金的投资范围进行如下变更。变更前，本基金的投资范围为现金，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、协议存款、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、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。变更后，本基金的投资范围为：现金，期限在一年以内（含一年）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，中国证监会及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。

7.4.2 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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

本基金的金融资产于初始确认时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。

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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；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) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(2) 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，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。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。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

(1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

(2) 债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 回购协议

1) 本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(4) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，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；

2) 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，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

7.4.4.8 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实际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帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

(2) 债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 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；

(4) 债券投资收益/损失于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

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

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”，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，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人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；

(4) 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，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益，若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；在每日收益支付时，若当日净收益大于零，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益等于零，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零，缩减投资人基金份额；

(6) 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个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 分部报告

无。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 增值税

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，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：

- （一）提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；
- （二）转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-------------------|
| 国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”） | 基金管理人、注册登记机构、直销机构 |
| 徽商银行股份有限公司（简称“徽商银行”） | 基金托管人、销售机构 |
| 中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”） | 基金管理人的股东 |
| 安保资本投资有限公司（简称“安保资本”） | 基金管理人的股东 |
| 中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”） | 基金管理人的最终控制人 |
| 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 |
| 国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”） | 基金管理人的子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本报告期末及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易，亦无应支付关联方的佣金。

7.4.8.1 关联方报酬

7.4.8.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,078,583.84 | 8,395,508.39 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,099,983.05 | 2,222,539.10 |

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,231,433.62 | 3,358,203.19 |

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 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.1.3 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 |
|---------------|----------------------------------|
| | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 徽商银行 | 4,199,963.45 |
| 国寿安保 | 647,185.16 |
| 合计 | 4,847,148.61 |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间 |
| | 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 |
| 徽商银行 | 3,889,235.27 |
| 国寿安保 | 1,148,004.37 |
| 合计 | 5,037,239.64 |

注：销售服务费每日计提，按月支付。销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.8.2 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 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 |
| 徽商银行 | 49,451,550.00 | - | - | - | - | - |

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|---|--|
| | 期初持有的基金份额 | 4,586,839.30 |
| 期间申购/买入总份额 | 10,057,835.63 | 175,441.72 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | 14,631,393.85 | - |
| 期末持有的基金份额 | 13,281.08 | 4,586,839.30 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 0.00% | 0.12% |

注：报告期间申购/买入总份额中含有红利再投资 57,835.63 份。

7.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 | 上年度末 |
|-------|-----|------|
|-------|-----|------|

Comment [□□□]: 这一列是 2016 年数据，请修改

| | 2018 年 12 月 31 日 | | 2017 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 | - | - | 500,000,000.00 | 13.1800% |
| 徽商银行 | 292.92 | 0.0000% | | |

7.4.8.4 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 |
| 徽商银行 | 1,714,719.58 | 14,884.55 | 12,092,830.70 | 821,480.83 |

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

7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度均未在承销期内直接通过关联方购入证券。

7.4.8.6 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。

7.4.9 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 |
|----------------|---------------|---------------|----------------|----|
| 129,797,523.86 | - | -1,033,670.22 | 128,763,853.64 | - |

7.4.10 (2018 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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人民币 201,041,378.44 元，分别于 2018 年 1 月 2 日，

2018 年 1 月 4 日到期。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 |
|-----------|---------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 120227 | 12 国开 27 | 2019 年 1 月 4 日 | 99.84 | 600,000 | 59,904,060.42 |
| 160208 | 16 国开 08 | 2019 年 1 月 4 日 | 99.75 | 1,000,000 | 99,752,127.86 |
| 140303 | 14 进出 03 | 2019 年 1 月 4 日 | 100.10 | 349,000 | 34,934,390.10 |
| 111820089 | 18 广发银行 CD089 | 2019 年 1 月 2 日 | 99.79 | 115,000 | 11,475,766.20 |
| 合计 | | | | 2,064,000 | 206,066,344.58 |

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于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。

§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 | 1,580,491,239.92 | 71.20 |
| | 其中:债券 | 1,580,491,239.92 | 71.20 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 631,714,719.58 | 28.46 |
| 4 | 其他各项资产 | 7,481,550.27 | 0.34 |
| 5 | 合计 | 2,219,687,509.77 | 100.00 |

8.2 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 | 6.62 | |
| | 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 | 201,041,378.44 | 9.97 |
| | 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%。

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 | 88 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 115 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 54 |

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投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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 | 17.43 | 9.97 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 19.74 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 22.71 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 18.78 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 31.06 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 109.71 | 9.97 |

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。

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 | 289,867,108.79 | 14.38 |
| | 其中：政策性金融债 | 289,867,108.79 | 14.38 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,290,624,131.13 | 64.01 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,580,491,239.92 | 78.38 |
| 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 | 111807190 | 18 招商银行 CD190 | 1,500,000 | 147,183,403.29 | 7.30 |
| 2 | 111812089 | 18 北京银行 CD089 | 1,000,000 | 99,902,010.25 | 4.95 |
| 3 | 111894921 | 18 南京银行 CD057 | 1,000,000 | 99,900,952.17 | 4.95 |
| 4 | 160208 | 16 国开 08 | 1,000,000 | 99,752,127.86 | 4.95 |

| | | | | | |
|----|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| 5 | 111810563 | 18 兴业银行 CD563 | 1,000,000 | 99,518,350.01 | 4.94 |
| 6 | 111809388 | 18 浦发银行 CD388 | 1,000,000 | 99,495,093.25 | 4.93 |
| 7 | 111820227 | 18 广发银行 CD227 | 1,000,000 | 99,494,759.72 | 4.93 |
| 8 | 111804036 | 18 中国银行 CD036 | 1,000,000 | 99,489,828.81 | 4.93 |
| 9 | 111815432 | 18 民生银行 CD432 | 1,000,000 | 99,444,095.17 | 4.93 |
| 10 | 111818359 | 18 华夏银行 CD359 | 1,000,000 | 99,381,866.86 | 4.93 |

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 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2482% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0138% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0945% |

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%的情况。

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%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

上海浦东发展银行于 2018 年 1 月 19 日公告称，其成都分行于当日收到中国银行业监督管理委员会四川监管局行政处罚决定书（川银监罚字[2018]2 号），对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处并执行罚款 46,175 万元人民币。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。上述处罚金额已全额计入 2017 年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。

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 | 7,481,550.27 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 7,481,550.27 |

8.9.4 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。

§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

| 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 |
| 62,857 | 32,078.24 | 206,534,322.45 | 10.82% | 1,798,202,350.88 | 89.18% |

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 | 基金类机构 | 82,633,901.59 | 4.10% |
| 2 | 基金类机构 | 53,121,319.80 | 2.63% |
| 3 | 银行类机构 | 26,059,244.08 | 1.29% |
| 4 | 基金类机构 | 25,421,845.51 | 1.26% |
| 5 | 个人 | 14,207,498.16 | 0.70% |
| 6 | 个人 | 9,104,269.38 | 0.45% |
| 7 | 个人 | 8,874,266.58 | 0.44% |
| 8 | 个人 | 8,429,700.53 | 0.42% |
| 9 | 个人 | 5,291,456.35 | 0.03% |
| 10 | 个人 | 5,213,034.78 | 0.03% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 324,456.04 | 0.02% |

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 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|-----------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 3 月 2 日）基金份额总额 | 258,294,341.88 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,794,934,947.84 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 15,837,132,360.85 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 17,615,725,638.77 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,016,341,669.92 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

(1) 2018 年 2 月 10 日，本基金管理人发布公告，王文英女士自 2018 年 2 月 7 日起任公司总经理助理；

(2) 2018 年 3 月 3 日，本基金管理人发布公告，董瑞倩女士自 2018 年 2 月 28 日起任公司固定收益投资总监；

(3) 2018 年 3 月 10 日，本基金管理人发布公告，张琦先生自 2018 年 3 月 7 日起任公司股票投资总监；

(4) 2018 年 5 月 12 日，本基金管理人发布公告，王福新先生自 2018 年 5 月 9 日起任公司总经理助理；

(5) 2018 年 7 月 14 日，本基金管理人发布公告，封雪梅女士因个人原因自 2018 年 7 月 6 日起离任公司总经理助理；

(6) 2018 年 7 月 27 日，本基金管理人发布公告，王大朋先生自 2018 年 7 月 25 日起任公司总经理助理；

(7) 2018 年 8 月 30 日，本基金管理人发布公告，石伟先生自 2018 年 8 月 29 日起任公司资产配置总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局《关于对国寿安保基金管理有限公司采取责令改正并暂停办理相关业务措施的决定》，责令公司进行整改，并暂停受理公募基金产品注册申请 3 个月。公司高度重视，制定相关整改措施，并持续进行全面整改。公司对行政监管措施决定书指出的问题已整改完毕并向监管部门报告了整改报告，整改已完成验收。本报告期内，基金管理人的高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 银河证券 | 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

11.8 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。

§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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

国寿安保基金管理有限公司

2019 年 3 月 30 日