

**国联安货币市场证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 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：二〇一九年三月三十日

## §1 重要提示

### 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 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。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金简称	国联安货币	
基金主代码	253050	
交易代码	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	11,225,085,851.11 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	151,484,319.77 份	11,073,601,531.34 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"> <li>1、利率预期策略</li> <li>2、收益率曲线策略</li> <li>3、类属配置策略</li> <li>4、现金流管理策略</li> <li>5、套利策略</li> <li>6、个券选择策略</li> </ol>

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	李华	胡波
	联系电话	021-38992888	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.cpicfunds.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

## §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.	2018 年		2017 年		2016 年	
1 期 间 数 据	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

和 指 标						
本 期 已 实 现 收 益	4,576,484.14	168,596,135.46	3,200,928.75	117,476,031.2 4	1,457,025.68	383,996,967.59
本 期 利 润	4,576,484.14	168,596,135.46	3,200,928.75	117,476,031.2 4	1,457,025.68	383,996,967.59
本 期 净 值 收 益 率	3.3189%	3.5673%	3.4743%	3.7231%	2.5553%	2.8016%
<b>3.1.</b>	<b>2018 年末</b>		<b>2017 年末</b>		<b>2016 年末</b>	
<b>2 期</b>						
<b>末</b>						
<b>数</b>						
<b>据</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	国联安货币 A	国联安货币 B
<b>和</b>						
<b>指</b>						
<b>标</b>						
<b>期</b>	151,484,319.	11,073,601,531.	148,874,984.	4,800,143,193.	126,067,103.	16,993,936,355.

末基金资产净值	77	34	76	27	28	89
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

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	0.6420%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.3017%	0.0011%
过去六个月	1.3292%	0.0021%	0.6805%	0.0000%	0.6487%	0.0021%
过去一年	3.3189%	0.0027%	1.3500%	0.0000%	1.9689%	0.0027%
过去三年	9.6403%	0.0028%	4.0537%	0.0000%	5.5866%	0.0028%
过去五年	17.6136%	0.0044%	6.7537%	0.0000%	10.8599%	0.0044%

自基金合同生效起至今	29.9201%	0.0048%	10.8887%	0.0001%	19.0314%	0.0047%
------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

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	0.7027%	0.0011%	0.3403%	0.0000%	0.3624%	0.0011%
过去六个月	1.4522%	0.0021%	0.6805%	0.0000%	0.7717%	0.0021%
过去一年	3.5673%	0.0027%	1.3500%	0.0000%	2.2173%	0.0027%
过去三年	10.4328%	0.0028%	4.0537%	0.0000%	6.3791%	0.0028%
过去五年	19.0354%	0.0044%	6.7537%	0.0000%	12.2817%	0.0044%
自基金合同生效起至今	32.4204%	0.0048%	10.8887%	0.0001%	21.5317%	0.0047%

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。

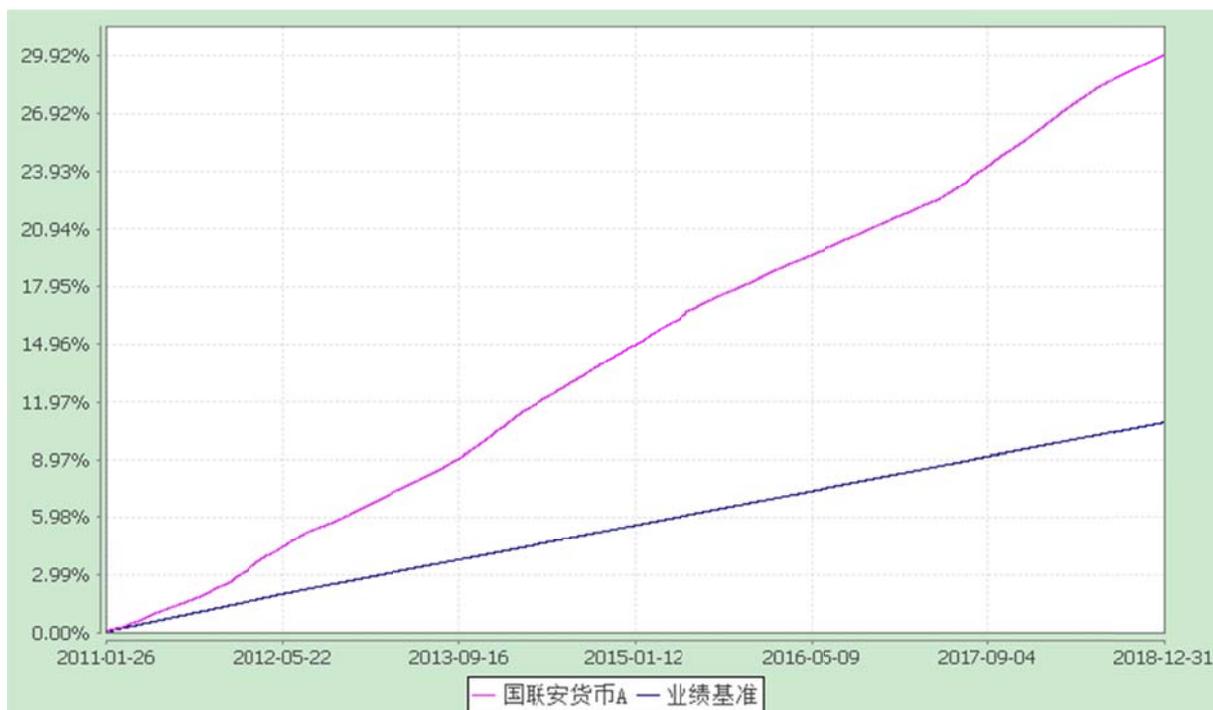
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 国联安货币市场证券投资基金

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 2018 年 12 月 31 日)

#### 1、国联安货币 A

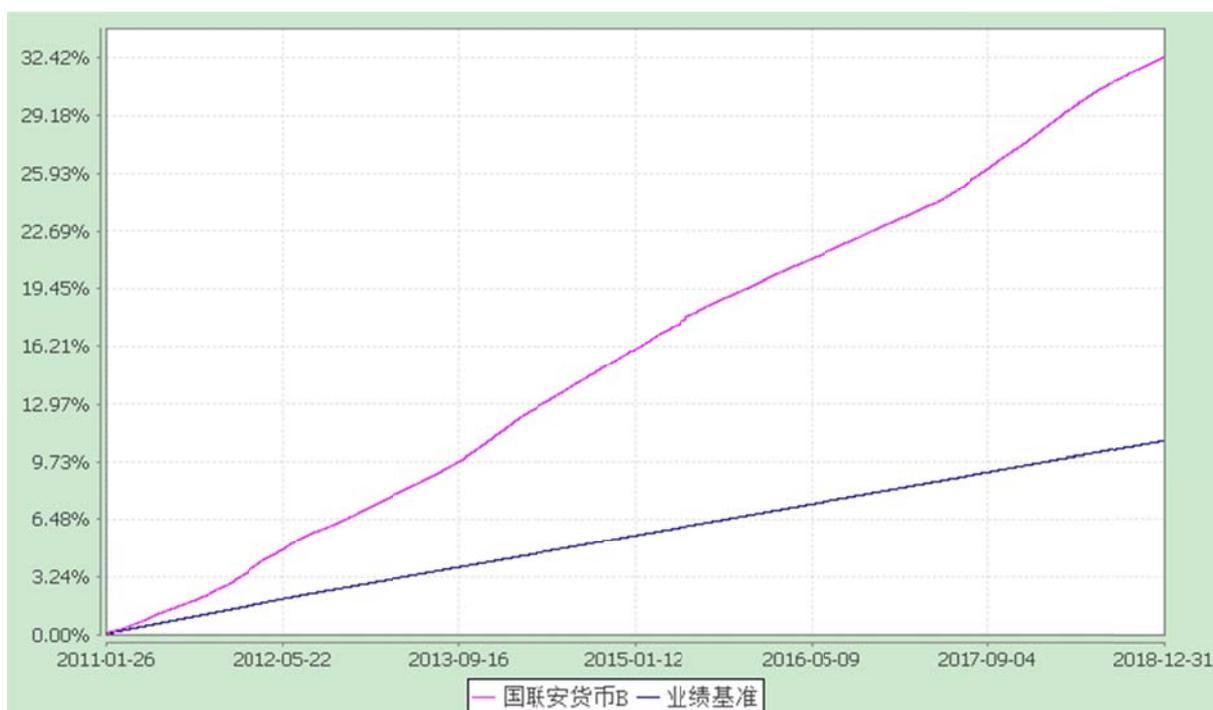


注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

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；

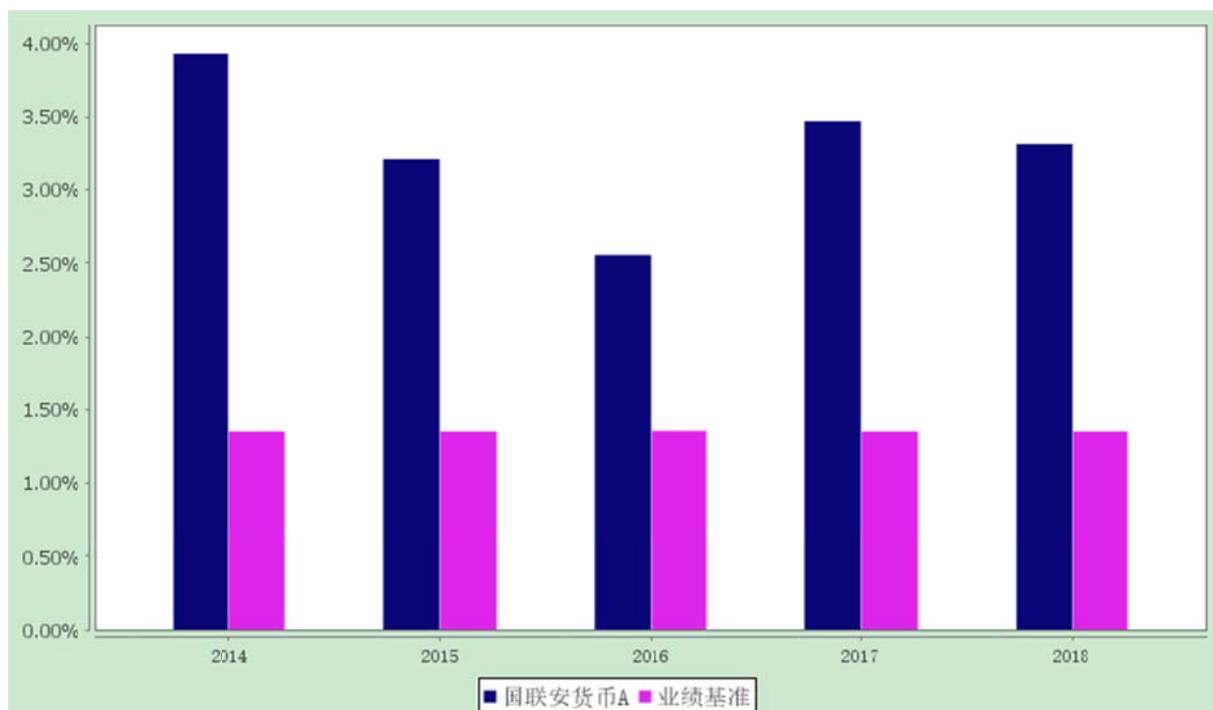
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

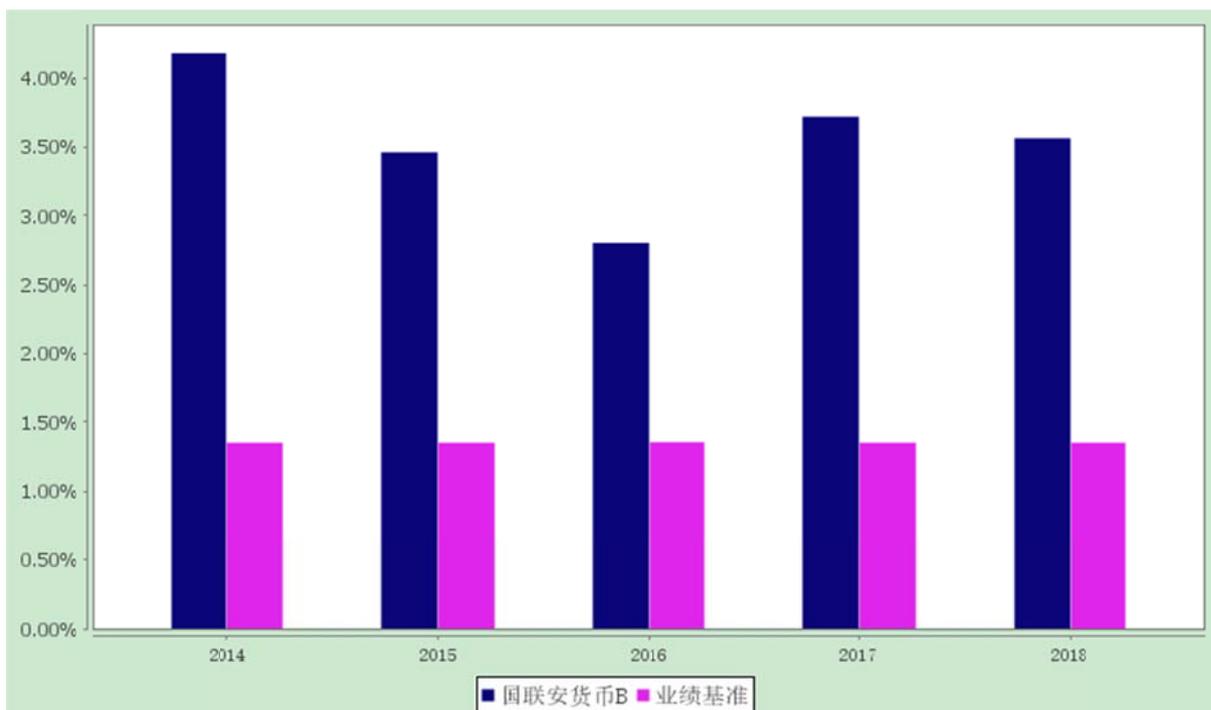
过去五年基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 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
2018	4,576,484.14	-	-	4,576,484.14	-
2017	3,200,928.75	-	-	3,200,928.75	-
2016	1,457,025.68	-	-	1,457,025.68	-
合计	9,234,438.57	-	-	9,234,438.57	-

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
2018	168,596,135.46	-	-	168,596,135.46	-
2017	117,476,031.24	-	-	117,476,031.24	-

2016	383,996,967.59	-	-	383,996,967.59	-
合计	670,069,134.29	-	-	670,069,134.29	-

## §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，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；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。国联安基金管理有限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		
欧阳健	本基金基金经理、兼任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理、固定收益部总经理。	2018-06-22	-	16 年（自 2002 年起）	欧阳健先生，硕士研究生。2002 年 9 月至 2016 年 2 月担任广发银行股份有限公司金融市场部利率及衍生产品交易主管；2016 年 2 月至 2018 年 5 月担任广发证券股份有限公司固定收益投资部部门执行董事；2018 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，担任固定收益部副总监，现任固定收益部总经理。2018 年 6 月起任国联安货币市场证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起任国联安增富一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金和国联安增裕一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。

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、国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2015-12-25	2018-06-28	11 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 月至 2018 年 6 月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 月至 2018 年 3 月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 月至 2018 年 5 月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 月至 2018 年 6 月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	-	7 年（自 2011 年起）	-
薛琳	本基金基金经理助理。	2018-05-30	-	12 年（自 2006 年起）	-
欧阳健	本基金基金经理助理。	2018-05-30	2018-06-21	16 年（自 2002 年起）	-
洪阳场	本基金基金经理助理。	2018-08-03	-	5 年	-

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。本基金管理人针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

2018 年中国经济增速表现出放缓态势，全球经济增长除美国表现一枝独秀外，欧元区、日本等主要经济地区都呈现出增速放缓姿态。在此背景下，年内美联储加息四次，英国央行加息一次，而欧洲央行、日本央行则继续维持超低利率水平。

2018 年中国央行继续保持稳健中性的货币政策，分别于一月、四月、七月、十月实施四次降准，并且增量开展了中期借贷便利（MLF）操作，在此基础上，货币市场利率明显下行，流动性期限结构有所改善。利率中枢总体稳中有降，银行间 7 天期质押式回购利率（DR007）从 2017 年末的 2.9% 左右下降 2018 年底的 2.5% 左右。10 年期国债收益率全年下行约 75BP 左右。

回顾 2018 年全年，一季度国内经济基本面呈现平稳边际回落迹象，PPI 继续回落，CPI 虽然上行但未超市场预期，通胀预期被证伪。央行实施普惠定向降准，并在春节期间启用临时降准工具（CRA），使得银行超储改善。二季度通胀继续回落，名义 GDP 大幅下行，金融监管导致非标融资受限，中美贸易摩擦爆发，以上原因促使央行货币政策出现边际宽松。三季度国内经济基本面延续偏弱的格局，基本面对货币政策有宽松需求，但在贸易摩擦背景下，人民币贬值压力较大，制约内部政策的宽松能力。四季度社融表现仍然较差，信贷和非标融资也并未见显著改善。油价和国内大宗商品大幅下跌，市场通胀预期明显下行。央行决定创设定向中期借贷便利 TMLF，货币政策边际仍然宽松。

本基金在 2018 年全年继续保持稳健谨慎操作，于年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努力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 3.3189%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。国联安货币 B 净值收益率为 3.5673%，同期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

2019 年中美经贸关系依旧存在较大不确定性，外部风险不容低估，国内经济下行压力或有所增大，为此货币政策大概率将延续稳健中性的基调，流动性整体将保持在充裕状态。

本基金将谨慎投资，择机配置存单、存款和高等级信用债券，在保证流动性的同时配合部门波动操作，努力为投资者在保障流动性的基础上获取稳健收益。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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 4,576,484.14 元，向本基金 B 级份额持有人共分配利润 168,596,135.46 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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证券投资基金的托管过程中，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，对国联安货币市场证券投资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

本报告期的基金财务会计报告经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师黄小熠、钱茹雯签字出具了毕马威华振审字第 1900074 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过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：国联安货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	2,706,928,876.96	825,361,658.79
结算备付金	43,125,909.09	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,110,508,491.60	2,688,446,626.71
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,110,508,491.60	2,688,446,626.71
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,969,514,604.26	1,792,328,048.49
应收证券清算款	50,151,709.91	-
应收利息	38,996,455.42	17,879,999.15
应收股利	-	-
应收申购款	308,863,156.19	100,028,037.66
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>11,228,089,203.43</b>	<b>5,424,044,370.80</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
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	-	472,409,251.37
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	687,624.11
应付管理人报酬	1,776,079.81	784,304.72

应付托管费	538,205.99	237,668.08
应付销售服务费	74,152.92	51,255.19
应付交易费用	72,573.03	84,173.03
应交税费	248,340.57	243,178.08
应付利息	-	227,706.75
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	294,000.00	301,031.44
<b>负债合计</b>	<b>3,003,352.32</b>	<b>475,026,192.77</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	11,225,085,851.11	4,949,018,178.03
未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>11,225,085,851.11</b>	<b>4,949,018,178.03</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>11,228,089,203.43</b>	<b>5,424,044,370.80</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 11,225,085,851.11 份。其中国联安货币 A 份额为 151,484,319.77 份；国联安货币 B 份额为 11,073,601,531.34 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

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
<b>一、收入</b>	<b>204,753,471.32</b>	<b>150,408,825.48</b>
1.利息收入	200,235,746.66	154,388,867.77
其中：存款利息收入	45,135,401.96	42,143,354.36
债券利息收入	110,040,471.81	101,120,720.03
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	45,059,872.89	11,124,793.38

其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,517,724.66	-4,194,240.58
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,517,724.66	-4,194,240.58
资产支持证券投资收益	-	-
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）	-	214,198.29
<b>减：二、费用</b>	<b>31,580,851.72</b>	<b>29,731,865.49</b>
1. 管理人报酬	16,720,250.46	12,276,737.11
2. 托管费	5,066,742.48	3,720,223.32
3. 销售服务费	834,485.08	583,471.54
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	8,505,677.26	12,742,894.60
其中：卖出回购金融资产支出	8,505,677.26	12,742,894.60
6. 税金及附加	52,509.07	-
7. 其他费用	401,187.37	408,538.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>173,172,619.60</b>	<b>120,676,959.99</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>173,172,619.60</b>	<b>120,676,959.99</b>

### 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：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）	4,949,018,178.03	-	4,949,018,178.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,172,619.60	173,172,619.60
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）	6,276,067,673.08	-	6,276,067,673.08
其中：1.基金申购款	34,113,176,977.30	-	34,113,176,977.30
2.基金赎回款	-27,837,109,304.22	-	-27,837,109,304.22
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）	-	-173,172,619.60	-173,172,619.60
五、期末所有者权益（基金净值）	11,225,085,851.11	-	11,225,085,851.11
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）	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的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-12,170,985,281.14	-	-12,170,985,281.14
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

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、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、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、同业存单，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 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 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、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东（截止至 2018 年 5 月 3 日）、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）	基金管理人的股东（自 2018 年 5 月 4 日起）
安联集团	基金管理人的股东

注：自 2018 年 5 月 4 日起，本基金管理人的控股股东由国泰君安证券股份有限公司变更为太平洋资产管理有限责任公司，因此自 2018 年 5 月 4 日起，国泰君安证券股份有限公司不再属于本基金的关联方。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

本报告期内所披露的与国泰君安证券股份有限公司之间的关联方交易均为发生在截至 2018 年 5 月 3 日止期间的交易，所披露的与太平洋资产管理有限责任公司之间的关联方交易均为发生在自 2018 年 5 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日止期间的交易。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 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。

##### 7.4.8.1.2 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。

##### 7.4.8.1.3 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。

##### 7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：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	
	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	1,182,918,000.00	2.69%	810,000,000.00	100.00%

##### 7.4.8.1.5 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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31
----	----------------------------	---------------------------------

	日	日
当期发生的基金应支付的管理费	16,720,250.46	12,276,737.11
其中：支付销售机构的客户维护费	950,475.63	443,490.24

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：

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

#### 7.4.8.2.2 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	5,066,742.48	3,720,223.32

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：

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

#### 7.4.8.2.3 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		
	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		
	国联安货币 A	国联安货币 B	合计
浦发银行	7,772.79	48.48	7,821.27
国泰君安	2,321.88	774.43	3,096.31
国联安基金管理有限	57,216.99	434,264.27	491,481.26

公司			
合计	67,311.66	435,087.18	502,398.84
获得销售服务费的各关联方名称	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		
	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

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。

### 7.4.8.3 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 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
浦发银行	-	-	-	-	477,100,000.0 0	34,768.75
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
浦发银行	-	99,781,338.71	-	-	-	-

#### 7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	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	
	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	-	303,586,105.86	-	377,054,937.76
期间申购/买入总份额	-	10,148,325.10	-	11,531,168.10
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	158,450,000.00	-	85,000,000.00
期末持有的基金份额	-	155,284,430.96	-	303,586,105.86
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.40%	-	6.32%

##### 7.4.8.4.2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 B

份额单位：份

关联方名称	国联安货币B本期末	国联安货币B上年度末

	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
太平洋资管	125,387,834.43	1.13%	-	-

#### 7.4.8.5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 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
浦发银行	6,928,876.96	2,699,689.58	111,361,658.79	13,972,055.36

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 2018 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 43,125,909.09 元。于 2017 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 0 元。

#### 7.4.8.6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。

#### 7.4.8.7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。

#### 7.4.9期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1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。

##### 7.4.9.2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

##### 7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1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 0 元，因此没有作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

##### 7.4.10.1.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2018 年 12 月 31 日，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工具中属于第二层次的余额为人民币 5,110,508,491.60 元，无属于第一层次、第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第二层次的余额为人民币 2,688,446,626.71 元，无属于第一层次、第三层次的余额）。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2017 年 12 月 31 日：无）。

##### 7.4.10.1.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## §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	5,110,508,491.60	45.52
	其中：债券	5,110,508,491.60	45.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,969,514,604.26	26.45
	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	2,750,054,786.05	24.49
4	其他各项资产	398,011,321.52	3.54
5	合计	11,228,089,203.43	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	6.54	
	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	-	-
	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

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

### 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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

#### 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	46.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	26.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	5.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	96.93	-

#### 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	69,616,643.23	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	490,615,354.59	4.37
	其中：政策性金融债	490,615,354.59	4.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	291,020,157.34	2.59
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,259,256,336.44	37.94
8	其他	-	-
9	合计	5,110,508,491.60	45.53
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	111883354	18 宁波银行 CD157	5,000,000	497,380,437.58	4.43
2	111806216	18 交通银行 CD216	4,000,000	396,722,510.61	3.53
3	111818342	18 华夏银行 CD342	3,000,000	298,437,390.04	2.66
4	111804036	18 中国银行 CD036	3,000,000	298,231,547.65	2.66
5	111809427	18 浦发银行 CD427	3,000,000	297,442,424.88	2.65
6	011800894	18 华电股 SCP003	2,000,000	200,962,330.23	1.79
7	111818235	18 华夏银行 CD235	2,000,000	198,821,077.75	1.77
8	111809420	18 浦发银行 CD420	2,000,000	198,444,378.89	1.77
9	111809289	18 浦发银行 CD289	2,000,000	198,384,152.04	1.77
10	111807072	18 招商银行 CD072	1,500,000	148,872,990.96	1.33

#### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.14%
报告期内偏离度的最低值	-0.02%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.05%

#### 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浦发银行和招商银行外，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。

18 浦发银行 CD427(111809427)、18 浦发银行 CD420(111809420)和 18 浦发银行 CD289(111809289)的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司由于十九项违法违规事项于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元；此外，成都分行由于九项违法违规事项于 2018 年 1 月 18 日被中国银行业监督管理委员会四川监管局罚款人民币 46175 万元。

18 招商银行 CD072（111807072）的发行主体招商银行股份有限公司因十四项违法违规事项于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 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	50,151,709.91
3	应收利息	38,996,455.42
4	应收申购款	308,863,156.19

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	398,011,321.52

## §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	7,854	19,287.54	42,609,519.06	28.13%	108,874,800.71	71.87%
国联安货币 B	78	141,969,250.40	10,879,989,615.63	98.25%	193,611,915.71	1.75%
合计	7,932	1,415,164.63	10,922,599,134.69	97.31%	302,486,716.42	2.69%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安货币 A	5,800,056.67	3.83%
	国联安货币 B	-	-
	合计	5,800,056.67	0.05%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	国联安货币 A	>100
	国联安货币 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开	国联安货币 A	0~10

开放式基金	国联安货币 B	0
	合计	0~10

## §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	148,874,984.76	4,800,143,193.27
本报告期基金总申购份额	600,283,159.19	33,512,893,818.11
减：本报告期基金总赎回份额	597,673,824.18	27,239,435,480.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	151,484,319.77	11,073,601,531.34

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、2018 年 3 月 30 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，刘轶先生不再担任公司督察长职务，由总经理孟朝霞女士代行督察长职务。

2、2018 年 4 月 27 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司董事、独立董事变更公告》，于业明先生、杨一君先生、Jiachen Fu 女士和 Eugen Loeffler 先生担任公司第五届董事会董事，公司总经理孟朝霞女士继续担任公司第五届董事会董事；贝多广先生、岳志明先生担任公司第五届董事会独立董事，胡斌先生继续担任公司第五届董事会独立董事。庾启斌先生、汪卫杰先生不再担任本公司董事；程静萍女士不再担任本公司独立董事。

3、2018 年 4 月 27 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司关于董事长及法定代表人变

更公告》，于业明先生担任公司董事长及法定代表人，庾启斌先生不再担任公司董事长及法定代表人。

4、2018 年 4 月 28 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，满黎先生不再担任公司副总经理职务。

5、2018 年 9 月 21 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李华先生担任公司督察长职务，总经理孟朝霞女士不再代为履行督察长职责。

6、2018 年 9 月 21 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，蔡蓓蕾女士担任公司副总经理兼市场总监职务。

7、2018 年 6 月 22 日，基金管理人发布《国联安货币市场证券投资基金基金经理变更公告》，欧阳健先生担任本基金的基金经理。

8、2018 年 6 月 28 日，基金管理人发布《国联安货币市场证券投资基金基金经理变更公告》，侯慧娣女士不再担任本基金的基金经理。

9、本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 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（特殊普通合伙）的报酬为 6.5 万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续 8 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就现场检查中发现的问题下发《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，本基金管理人高度重视，制定并落实相关整改措施，及时向中国证券监督管理委员会上海监管局提交整改报告，顺利通过了该局的整改验收。

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 额的比例	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	-	-	43,937,279,000.00	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。

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	2018年1月1日至2018年3月20日	1,000,000.00	1,108,877.49	1,607,546,132.98	501,331,364.56	4.47%
	2	2018年4月4日至2018年6月27日	502,252,948.84	219,682,921.37	721,935,870.21	0.00	0.00%
	3	2018年3月22日至2018年5月9日	0.00	1,607,766.67	1,607,766,679.69	0.00	0.00%
	4	2018年8月27日至2018年9月26日	0.00	1,608,754.54	1,408,754,541.54	200,000,000.00	1.78%

产品特有风险

(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。

(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。

(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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2018 年 5 月 4 日发布公告，经本基金管理人股东会第五十五次会议决议通过，并经中国证券监督管理委员会批复核准（证监许可[2018]557 号），本基金管理人原股东国泰君安证券股份有限公司将所持 51%股权转让给太平洋资产管理有限责任公司。上述事项涉及的相关工商变更登记等事宜，已按规定办理完毕。变更后，本基金管理人的股东为太平洋资产管理有限责任公司和安联集团。

国联安基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日