

国寿安保稳泰一年定期开放混合型
证券投资基金
2019 年年度报告

2019 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 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
1.2 目录.....	3
§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.....	5
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 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
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.....	17
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	56
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§ 9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	61
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	国寿安保稳泰一年定开混合	
基金主代码	004772	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月22日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	258,230,483.53份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保稳泰一年定开混合 A	国寿安保稳泰一年定开混合 C
下属分级基金的交易代码:	004772	004773
报告期末下属分级基金的份额总额	198,162,971.75份	60,067,511.78份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将通过对宏观经济和资本市场的深入分析,采用主动的投资管理策略,把握不同时期各金融市场的收益水平,根据约定的投资比例配置股票、债券、货币市场工具等各类资产,在严格控制下行风险的前提下,力争为投资人获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	封闭期内,本基金的资产配置策略注重将定性资产配置和定量资产配置进行有机的结合,根据经济情景、类别资产收益风险预期等因素,确定不同阶段基金资产中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,力争获得基金资产的长期稳定增值。 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中等风险/收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95588
传真	010-50850776	010-66105798
注册地址	上海市虹口区丰镇路806号3幢306号	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	北京市西城区金融大街28号院盈泰商务中心2号楼11层	北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码	100033	100140
法定代表人	王军辉	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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	2019 年		2018 年		2017 年 8 月 22 日(基金合同生效 日)-2017 年 12 月 31 日	
	国寿安保稳泰一 年定开混合 A	国寿安保稳泰 一年定开混合 C	国寿安保稳泰 一年定开混合 A	国寿安保稳泰 一年定开混合 C	国寿安保稳泰一 年定开混合 A	国寿安保稳泰一 年定开混合 C
本期 已实 现收 益	4,692,725.38	1,792,535.52	-101,171.91	-1,918,794.45	1,240,431.05	3,117,729.65
本期 利润	8,915,497.96	3,336,835.31	-181,386.80	-2,623,822.13	1,518,748.21	4,000,084.77
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.1088	0.0832	-0.0022	-0.0103	0.0129	0.0108
本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率	10.16%	7.93%	-0.21%	-1.03%	1.28%	1.07%
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	7.91%	7.26%	0.85%	0.23%	1.29%	1.08%
3.1.2 期 末 数 据 和 指 标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期 末 可 供 分 配	11,834,029.61	2,681,986.89	231,478.55	86,340.77	1,240,431.05	3,117,729.65

利润						
期末可供分配基金份额利润	0.0597	0.0447	0.0113	0.0029	0.0106	0.0084
期末基金资产净值	218,426,196.49	65,275,306.07	21,007,417.35	29,923,010.66	118,975,799.48	376,048,593.26
期末基金份额净值	1.1023	1.0867	1.0215	1.0131	1.0129	1.0108
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	10.23%	8.67%	2.15%	1.31%	1.29%	1.08%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保稳泰一年定开混合 A

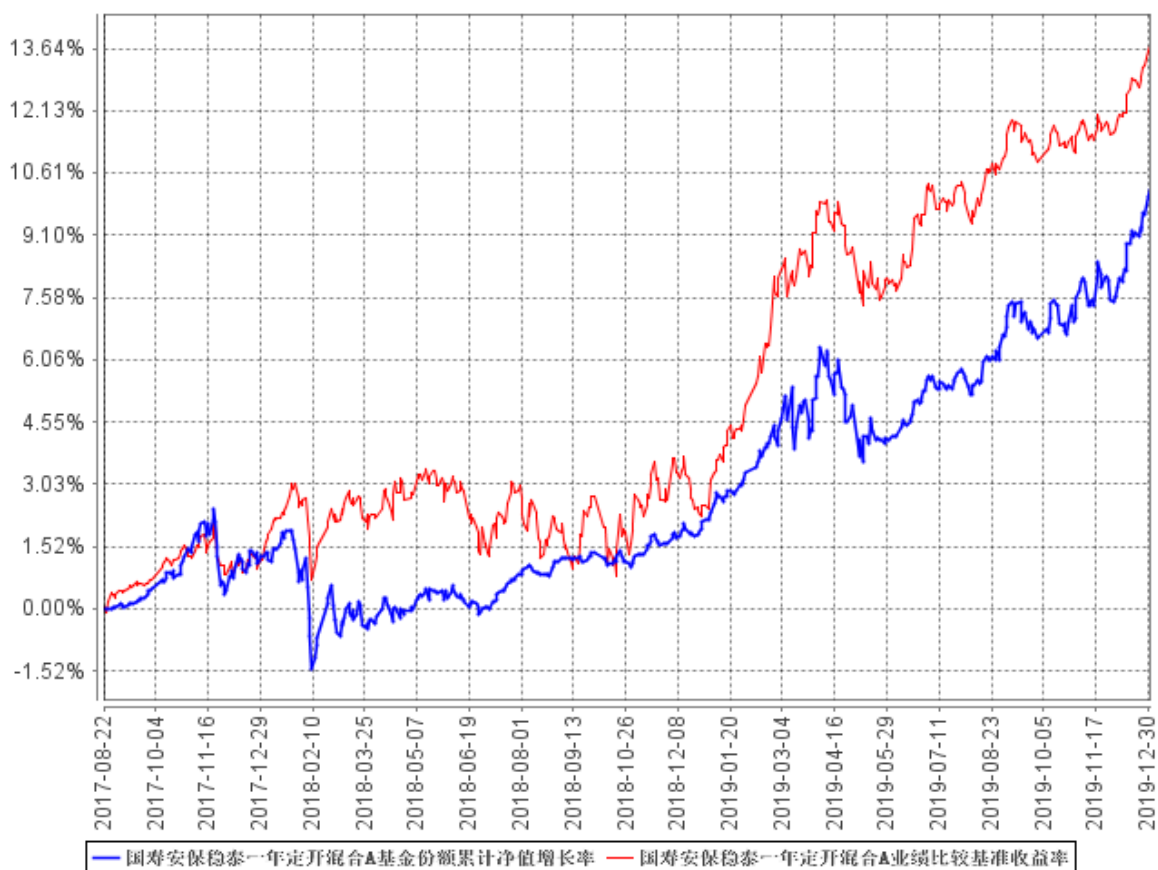
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.41%	0.23%	2.52%	0.15%	0.89%	0.08%
过去六个月	4.67%	0.19%	3.74%	0.17%	0.93%	0.02%
过去一年	7.91%	0.24%	10.90%	0.24%	-2.99%	0.00%
自基金合同生效起至今	10.23%	0.20%	13.70%	0.24%	-3.47%	-0.04%

国寿安保稳泰一年定开混合 C

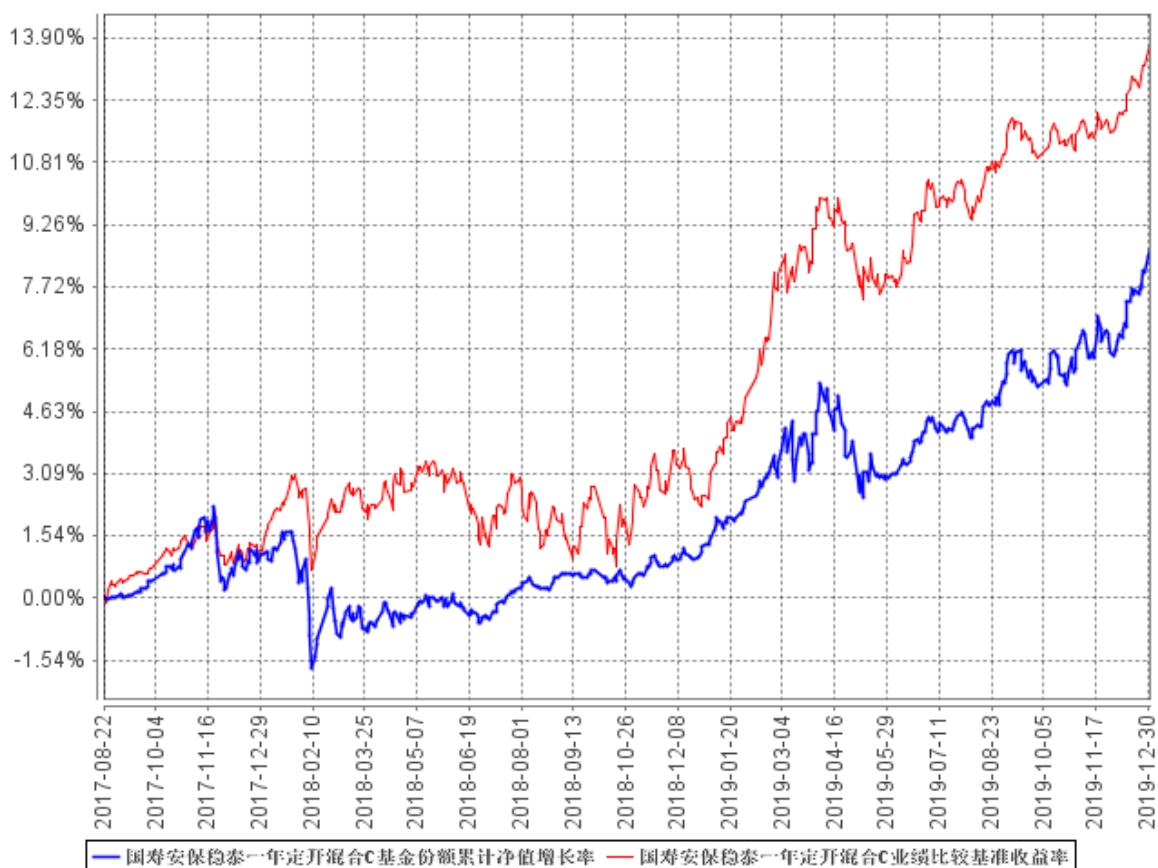
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.25%	0.23%	2.52%	0.15%	0.73%	0.08%
过去六个月	4.36%	0.19%	3.74%	0.17%	0.62%	0.02%
过去一年	7.26%	0.24%	10.90%	0.24%	-3.64%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.67%	0.20%	13.70%	0.24%	-5.03%	-0.04%

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

国寿安保稳泰一年定开混合A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



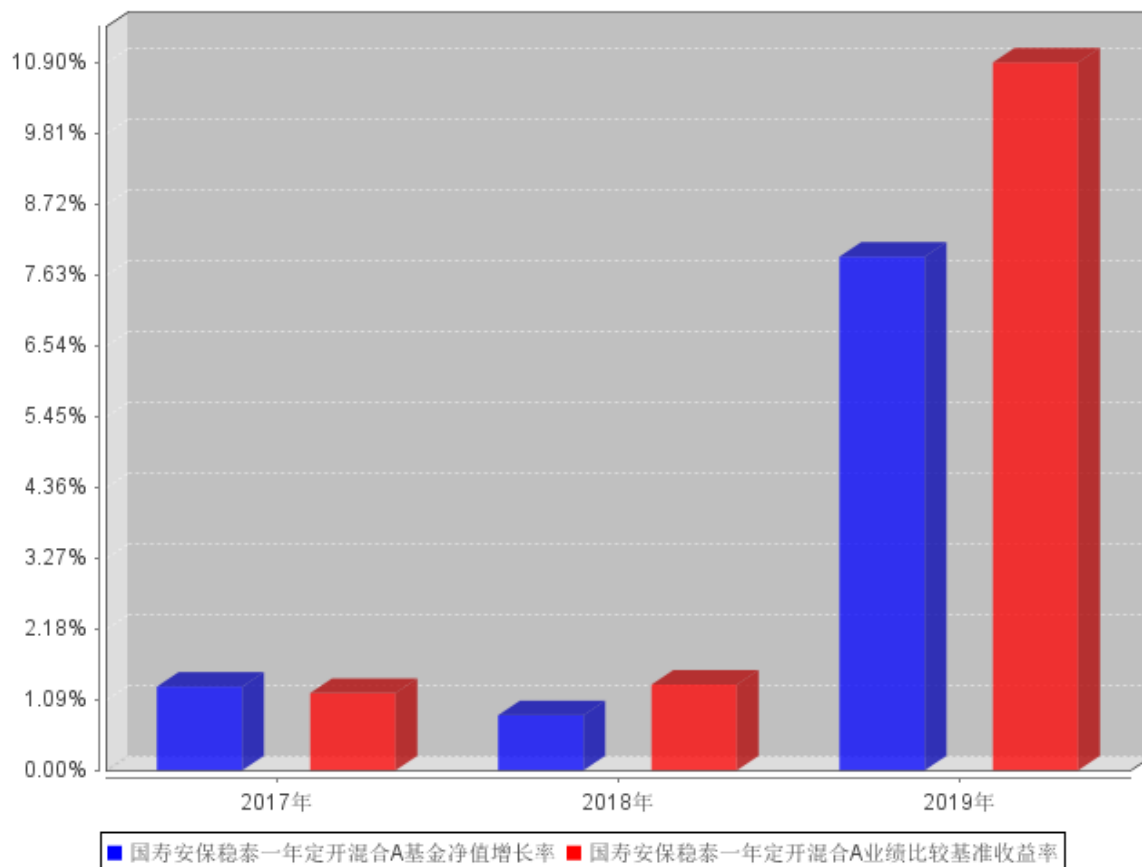
国寿安保稳泰一年定开混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



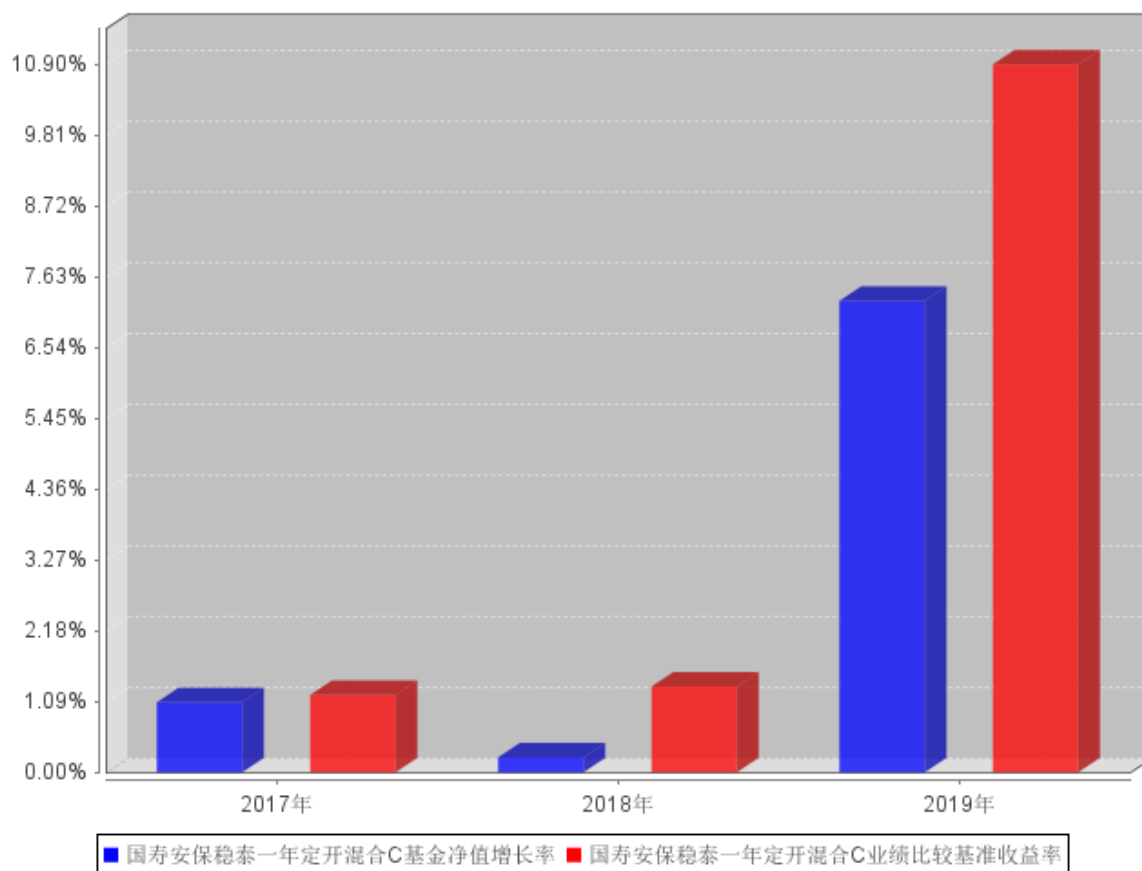
注：本基金基金合同生效日为 2017 年 8 月 22 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定，建仓期结束时，各项指标符合基金合同约定。图示日期为 2017 年 8 月 22 日至 2019 年 12 月 31 日。

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

国寿安保稳泰一年定开混合A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对比图



国寿安保稳泰一年定开混合C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

无。

§ 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（澳大利亚安安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2019 年 12 月 31 日，公司共管理 53 只公募基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2388.52 亿元，其中公募基金管理规模 1775.76 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴坚	基金经理	2017 年 10 月 26 日	-	12 年	吴坚先生，博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理、中国人寿资产管理有限公司一级研究员，现任国寿安保稳惠灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳诚混合型证券投资基金、国寿安保稳荣混合型证券投资基金、国寿安保策略精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金基金经理及国寿安保科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金。
吴闻	基金经理	2017 年 8 月 22 日	-	11 年	吴闻先生，硕士。曾任中信证券股份有限公司债务资本市场部高级经理，固定收益部副总裁，2014 年 9 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金

					<p>经理助理，现任国寿安保灵活优选混合型证券投资基金、国寿安保稳荣混合型证券投资基金、国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金、国寿安保安吉纯债半年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保稳吉混合型证券投资基金及国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

受中美贸易摩擦持续升温、英国脱欧及海外主要经济偏弱增长等因素影响，2019 年中国经济整体面临下行压力，但仍然保持了增长韧性。政府深化供给侧结构改革较好稳定了市场长期预期，逆周期调节力度加大，统筹兼顾做好了“六稳”工作，实体经济的融资环境显著改善。全年来看，实际 GDP 同比增 6.1%，较 2018 年温和回落，物价运行总体平稳，下半年猪周期启动是带动 CPI 走高的主要原因，但由于核心通胀走势稳定，货币政策并没有受到单一食品价格走高的制约。

从政策面来看，在全球主要央行重回宽松周期的背景下，2019 年我国央行的货币政策更加注重预调微调，货币政策放松多以配合财政政策发力或对冲特殊事件造成的流动性冲击和悲观预期为主，主动放松的意愿相对有限。在年初稳增长阶段、包商银行违约事件后、年中贸易摩擦升级等时点，央行进行了积极的流动性支持以稳定市场及预期。

2019 年中国债券市场总体呈现区间震荡格局，货币政策张弛有度，银行同业存单的刚性兑付有序打破，中高等级信用利差稳步收窄，信用违约事件仍然时有发生。2019 年 A 股市场总体呈现普涨行情。沪深 300、上证综指以及创业板指数分别上涨 36%、22% 和 44%。整体上看，在 2018 年系统性风险充分释放前提下，2019 年 A 股市场体现了估值修复性上涨。同时，在面临外部技术管制背景下，产业链国产化成为推动许多行业变化的重要力量，也推动了诸多行业股票大幅上涨。申万电子行业全年涨幅高达 74%，位居申万 28 个一级行业首位，食品饮料、家用电器和建筑材料行业涨幅都位居 50% 以上。

投资运作方面，本基金以高等级、中短久期信用债为主要配置品种，波段操作中长期利率债以增加组合收益弹性。股票方面，本基金 2019 年年初以来，将权益仓位控制在较低水平。三季度逐步增加了股票仓位，此后维持了较高的股票配置，主要方向为估值安全，业绩稳定、流动性好的标的，针对市场变化适当调整了持仓结构，同时积极参与科创板和主板的新股申购业务并及时兑现收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保稳泰一年定开混合 A 基金份额净值为 1.1023 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.91%；截至本报告期末国寿安保稳泰一年定开混合 C 基金份额净值为 1.0867 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.26%；同期业绩比较基准收益率为 10.90%。

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 2020 年，中国经济原本在 2019 年四季度出现弱复苏的迹象，但受到新冠肺炎疫情冲击，上半年经济增长出现下行压力，考虑到疫情波及的地区更广、人流限制措施更强，本次经济下行压力将强于非典时期，可选消费行业受到的影响较为严重，投资也受到节后复工节奏的影响。为对冲疫情影响，预计货币政策短期趋于宽松，财政政策可能通过扩大赤字率、发行特别国债等方式托底经济增长，房地产行业融资环境可能小幅改善，经济有望在疫情短期影响后迎来反弹，最终实现全年经济社会发展目标。

在物价层面，短期受到食品价格上涨因素影响，CPI 同比增速在上半年将位于相对高位，但核心 CPI 仍然温和，PPI 同比增速受疫情导致需求下滑影响趋于下行。综合来看，CPI 可能呈现前高后低走势，PPI 低位运行，通胀环境相对温和。

债券市场方面，考虑到全球疫情带来经济下行压力，通胀环境相对温和，以及货币政策、财政政策托底经济增长态度坚决，预计上半年债券市场存在阶段性机会，全年呈现震荡市格局。信用债和转债方面，高等级债券将继续获得资金青睐，低等级信用债仍需重点防范信用风险，可转债有望在 A 股结构性行情的推动下出现机会。

股市方面，经历 2019 年投资者情绪修复和产业链国产化替代双重推动上涨之后，影响 2020 年 A 股市场的重要逻辑将体现在下方面：首先，经历了 2019 年大幅上涨之后，A 股的部分行业需要业绩增速的确认以支持其估值水平。这决定了 2019 年修复式的全面上涨可能难以在 2020 年重复。其次，始于 2019 年的 5G 基站建设将在 2020 年开始大规模进行，同时 5G 手机的渗透率也将会快速提升。这为今后相当多的应用提供了基本的技术平台和场景。5G 产业链在消费端的投资机会将会大量涌现。第三，从大的环境上看，科技创新已经成为中国经济破局的明智选择，从产业政策到资本市场都将总体偏暖，整个大环境十分有利于科技创新板块的投资。总之，我们认为 2020 年的 A 股市场难以再现 2019 年的普涨行情，“分化”是 2020 年 A 股市场的重要特征。不论在不同行业之间，甚至在同一行业内部，那些能够持续投入研发，具备持续创新

能力，抓住新一轮科技创新大周期发展自己的公司，才具备中长期投资价值，也将迎来良好的投资机会。

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交易和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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，本基金托管人在对国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本托管人依法对国寿安保基金管理有限公司编制和披露的国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 61090605_A31 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人。
审计意见	我们审计了国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师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，我们独立于国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金，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。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则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，管理层负责评估国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营

	或别无其他现实的选择。 治理层负责监督国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 评价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。</p> <p>(4) 对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，就可能对国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资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寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>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（续）：</p> <p>(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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴军 范新紫
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2020年4月29日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,716,827.54	1,789,974.74
结算备付金		323,137.29	110,249.08
存出保证金		25,292.45	23,221.44
交易性金融资产	7.4.7.2	320,475,979.09	57,726,916.10
其中：股票投资		77,159,165.39	3,413,088.00
基金投资		-	-
债券投资		243,316,813.70	54,313,828.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	22,152.00
应收利息	7.4.7.5	4,085,600.62	882,314.24
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		328,626,836.99	60,554,827.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 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		42,000,000.00	9,500,000.00
应付证券清算款		2,509,567.42	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		142,542.88	25,880.62
应付托管费		35,635.72	6,470.13
应付销售服务费		32,803.50	15,207.21
应付交易费用	7.4.7.7	25,621.21	5,320.31
应交税费		12,933.12	2,093.72
应付利息		-3,769.42	9,427.60

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00	60,000.00
负债合计		44,925,334.43	9,624,399.59
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	258,230,483.53	50,101,585.42
未分配利润	7.4.7.10	25,471,019.03	828,842.59
所有者权益合计		283,701,502.56	50,930,428.01
负债和所有者权益总计		328,626,836.99	60,554,827.60

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，国寿安保稳泰一年定开混合 A 基金份额净值 1.1023 元，基金份额总额 198,162,971.75 份；国寿安保稳泰一年定开混合 C 基金份额净值 1.0867 元，基金份额总额 60,067,511.78 份。国寿安保稳泰一年定开混合份额总额合计为 258,230,483.53 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		14,186,655.97	4,030,281.42
1.利息收入		3,408,143.28	16,956,940.88
其中：存款利息收入	7.4.7.11	35,279.22	93,739.14
债券利息收入		3,144,629.41	15,556,429.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		228,234.65	1,306,772.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,011,440.32	-12,141,416.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,046,060.38	-10,818,733.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,784,965.94	-2,074,678.26
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	180,414.00	751,995.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,767,072.37	-785,242.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-

减：二、费用		1,934,322.70	6,835,490.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	781,728.25	2,019,837.24
2. 托管费	7.4.10.2.2	195,431.99	504,959.32
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	252,626.19	1,514,594.92
4. 交易费用	7.4.7.19	175,640.74	424,783.83
5. 利息支出		310,685.18	2,213,087.68
其中：卖出回购金融资产支出		310,685.18	2,213,087.68
6. 税金及附加		5,503.13	47,321.48
7. 其他费用	7.4.7.20	212,707.22	110,905.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,252,333.27	-2,805,208.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,252,333.27	-2,805,208.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	50,101,585.42	828,842.59	50,930,428.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,252,333.27	12,252,333.27
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）	208,128,898.11	12,389,843.17	220,518,741.28
其中：1. 基金申购款	232,296,982.32	13,701,517.68	245,998,500.00
2. 基金赎回款	-24,168,084.21	-1,311,674.51	-25,479,758.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	258,230,483.53	25,471,019.03	283,701,502.56
项目	上年度可比期间 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）	489,505,559.76	5,518,832.98	495,024,392.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,805,208.93	-2,805,208.93
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）	-439,403,974.34	-1,884,781.46	-441,288,755.80
其中：1. 基金申购款	5,134,953.26	64,186.92	5,199,140.18
2. 基金赎回款	-444,538,927.60	-1,948,968.38	-446,487,895.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	50,101,585.42	828,842.59	50,930,428.01

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

国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金（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”）《关于准予国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2017】772号）核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2017年7月21日至2017年8月17日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2017）验字第61090605_A09号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年8月22日正式生效。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。本基金将基金份额分为A类和C类不同的类别。在投资人认（申）购、赎回时，收取认（申）购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。首次募集规模为117,457,051.27份A

类基金份额，372,048,508.49 份 C 类基金份额。国寿安保稳诚混合 A 类及 C 类收到的实收基金合计人民币 489,505,559.76 元，分别折合成 A 类和 C 类基金份额，合计折合 489,505,559.76 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“工商银行”）。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以参与融资交易。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-30%；封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31

日止期间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

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。本期财务报表的实际编制期间系 2019 年 01 月 01 日（基金合同生效日）至 2019 年 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。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该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，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权

证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除

应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的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负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红

利或将现金红利按除权日的该类别基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 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 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（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。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

活期存款	3,716,827.54	1,789,974.74
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,716,827.54	1,789,974.74

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	71,539,697.37	77,159,165.39	5,619,468.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	119,576,273.99	119,864,813.70
	银行间市场	123,217,505.65	123,452,000.00
	合计	242,793,779.64	243,316,813.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	314,333,477.01	320,475,979.09	6,142,502.08
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,339,282.00	3,413,088.00	73,806.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	54,012,204.39	54,313,828.10
	银行间市场	-	-
	合计	54,012,204.39	54,313,828.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	57,351,486.39	57,726,916.10	375,429.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	681.84	339.49
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	159.94	54.56
应收债券利息	4,084,746.30	881,908.75
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	12.54	11.44
合计	4,085,600.62	882,314.24

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	21,959.51	5,320.31
银行间市场应付交易费用	3,661.70	-
合计	25,621.21	5,320.31

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	170,000.00	60,000.00
合计	170,000.00	60,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保稳泰一年定开混合 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,564,918.56	20,564,918.56
本期申购	188,428,490.68	188,428,490.68
本期赎回（以“-”号填列）	-10,830,437.49	-10,830,437.49
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	198,162,971.75	198,162,971.75

金额单位：人民币元

国寿安保稳泰一年定开混合 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,536,666.86	29,536,666.86
本期申购	43,868,491.64	43,868,491.64
本期赎回（以“-”号填列）	-13,337,646.72	-13,337,646.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	60,067,511.78	60,067,511.78

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保稳泰一年定开混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	231,478.55	211,020.24	442,498.79
本期利润	4,692,725.38	4,222,772.58	8,915,497.96
本期基金份额交易产生的变动数	6,909,825.68	3,995,402.31	10,905,227.99
其中：基金申购款	7,332,736.44	4,236,772.88	11,569,509.32
基金赎回款	-422,910.76	-241,370.57	-664,281.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,834,029.61	8,429,195.13	20,263,224.74

单位：人民币元

国寿安保稳泰一年定开混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,340.77	300,003.03	386,343.80
本期利润	1,792,535.52	1,544,299.79	3,336,835.31
本期基金份额交易产生的变动数	803,110.60	681,504.58	1,484,615.18
其中：基金申购款	1,155,127.19	976,881.17	2,132,008.36
基金赎回款	-352,016.59	-295,376.59	-647,393.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,681,986.89	2,525,807.40	5,207,794.29

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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	25,478.76	63,260.78
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,551.71	29,567.90
其他	248.75	910.46
合计	35,279.22	93,739.14

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	37,973,517.05	161,774,539.47
减：卖出股票成本总额	34,927,456.67	172,593,273.10
买卖股票差价收入	3,046,060.38	-10,818,733.63

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
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018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	1,784,965.94	-2,074,678.26
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	1,784,965.94	-2,074,678.26
----	--------------	---------------

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 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	202,027,960.07	1,531,826,121.13
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	198,069,617.73	1,506,714,223.22
减：应收利息总额	2,173,376.40	27,186,576.17
买卖债券差价收入	1,784,965.94	-2,074,678.26

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	180,414.00	751,995.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	180,414.00	751,995.00

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	5,767,072.37	-785,242.57
——股票投资	5,545,662.02	-6,884,985.52
——债券投资	221,410.35	6,099,742.95
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	5,767,072.37	-785,242.57

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无赎回费收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
交易所市场交易费用	171,415.74	412,458.83
银行间市场交易费用	4,225.00	12,325.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	175,640.74	424,783.83

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	10,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
银行费用	5,507.22	13,705.88
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
上清所账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	212,707.22	110,905.88

7.4.7.21 分部报告

无。

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**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人、注册登记机构、直销机构
工商银行	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	781,728.25	2,019,837.24
其中：支付销售机构的客户维护费	138,699.88	1,487,141.75

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 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	195,431.99	504,959.32

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 0.15% 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托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.1.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保稳泰一年定开混合 A	国寿安保稳泰一年定开混合 C	合计
工商银行	-	153,357.68	153,357.68
国寿安保	-	98,269.57	98,269.57
合计	-	251,627.25	251,627.25

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	国寿安保稳泰一年定开混合 A	国寿安保稳泰一年定开混合 C	合计
工商银行	-	1,511,366.32	1,511,366.32
国寿安保	-	1,038.84	1,038.84
合计	-	1,512,405.16	1,512,405.16

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	国寿安保稳泰一年定开混合 A	国寿安保稳泰一年定开混合 C
基金合同生效日（2017年8月22日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,456,444.47	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,456,444.47	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.7400%	-

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

	国寿安保稳泰一年定开混合 A	国寿安保稳泰一年定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 22 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	3,456,444.47	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,456,444.47	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.8100%	-

7.4.10.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 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
工商银行	3,716,827.54	25,478.76	1,789,974.74	63,260.78

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

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期及上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688123	聚辰股份	2019 年 12 月 16 日	2022 年 12 月 23 日	非公开发行流通受限	33.25	58.12	5,550	184,537.50	322,566.00	-

688366	昊海生科	2019年10月23日	2022年10月31日	非公开发行流通受限	89.23	79.78	2,711	241,902.53	216,283.58	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	43.98	43.98	3,588	157,800.24	157,800.24	-
688058	宝兰德	2019年10月25日	2022年11月1日	非公开发行流通受限	79.30	90.65	1,450	114,985.00	131,442.50	-
688078	龙软科技	2019年12月20日	2022年12月30日	非公开发行流通受限	21.59	41.95	2,811	60,689.49	117,921.45	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	新股流通受限	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
688310	迈得医疗	2019年11月22日	2022年12月5日	非公开发行流通受限	24.79	27.12	3,276	81,212.04	88,845.12	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110065	淮矿转债	2019年12月25日	2020年1月13日	新债发行未上市	100.00	100.00	450	45,000.00	45,000.00	-
113029	明阳转债	2019年12月18日	2020年1月7日	新债发行未上市	100.00	100.00	1,280	128,000.00	128,000.00	-
113030	东风转债	2019年12月26日	2020年1月20日	新债发行未上市	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.00	-
113554	仙鹤转债	2019年12月18日	2020年1月10日	新债发行未上市	100.00	100.00	290	29,000.00	29,000.00	-
123039	开润转债	2019年12月31日	2020年1月23日	新债发行未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-
128084	木森	2019年	2020	新债发	100.00	100.00	630	63,000.00	63,000.00	-

	转债	12月18日	2019年1月10日	行未上市						
128085	鸿达转债	2019年12月18日	2020年1月8日	新债发行未上市	100.00	100.00	810	81,000.00	81,000.00	-
128086	国轩转债	2019年12月31日	2020年1月10日	新债发行未上市	100.00	100.00	500	50,000.00	50,000.00	-

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而流通受限的证券。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易所形成的卖出回购证券款余额 42,000,000.00 元，于 2020 年 1 月 3 日到期。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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

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的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人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基金份额持有人在开放期内可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,716,827.54	-	-	-	3,716,827.54
结算备付金	323,137.29	-	-	-	323,137.29
存出保证金	25,292.45	-	-	-	25,292.45
交易性金融资产	36,269,339.80	163,257,135.60	43,790,338.30	77,159,165.39	320,475,979.09
应收利息	-	-	-	4,085,600.62	4,085,600.62
资产总计	40,334,597.08	163,257,135.60	43,790,338.30	81,244,766.01	328,626,836.99
负债					
卖出回购金融资产款	42,000,000.00	-	-	-	42,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2,509,567.42	2,509,567.42
应付管理人报酬	-	-	-	142,542.88	142,542.88
应付托管费	-	-	-	35,635.72	35,635.72
应付销售服务费	-	-	-	32,803.50	32,803.50
应付交易费用	-	-	-	25,621.21	25,621.21
应付利息	-	-	-	-3,769.42	-3,769.42
应交税费	-	-	-	12,933.12	12,933.12
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	42,000,000.00	-	-	2,925,334.43	44,925,334.43
利率敏感度缺口	-1,665,402.92	163,257,135.60	43,790,338.30	78,319,431.58	283,701,502.56
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,789,974.74	-	-	-	1,789,974.74
结算备付金	110,249.08	-	-	-	110,249.08
存出保证金	23,221.44	-	-	-	23,221.44
交易性金融资产	23,935,386.90	28,261,112.50	2,117,328.70	3,413,088.00	57,726,916.10

应收证券清算款	-	-	-	22,152.00	22,152.00
应收利息	-	-	-	882,314.24	882,314.24
资产总计	25,858,832.16	28,261,112.50	2,117,328.70	4,317,554.24	60,554,827.60
负债					
卖出回购金融资产款	9,500,000.00	-	-	-	9,500,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	25,880.62	25,880.62
应付托管费	-	-	-	6,470.13	6,470.13
应付销售服务费	-	-	-	15,207.21	15,207.21
应付交易费用	-	-	-	5,320.31	5,320.31
应付利息	-	-	-	9,427.60	9,427.60
应交税费	-	-	-	2,093.72	2,093.72
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	9,500,000.00	-	-	124,399.59	9,624,399.59
利率敏感度缺口	16,358,832.16	28,261,112.50	2,117,328.70	4,193,154.65	50,930,428.01

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	+25 个基点	-1,692,103.71	-379,261.93
	-25 个基点	1,692,103.71	379,261.93

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；

其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	77,159,165.39	27.20	3,413,088.00	6.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	243,316,813.70	85.77	54,313,828.10	106.64
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	320,475,979.09	112.96	57,726,916.10	113.34

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 日，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金及存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金于本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 97,466,067.83 元（上年度末：13,691,204.40 元），属于第二层次的余额为人民币 223,009,911.26 元（上年度末：44,035,711.70 元），本年度末及上年度末均无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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，本基金不会于停牌日至交易

恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次。本基金根据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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 4 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	权益投资	77,159,165.39	23.48
	其中：股票	77,159,165.39	23.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	243,316,813.70	74.04
	其中：债券	243,316,813.70	74.04
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,039,964.83	1.23
8	其他各项资产	4,110,893.07	1.25
9	合计	328,626,836.99	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,927,500.00	1.74
C	制造业	37,175,698.40	13.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,783,000.00	1.69
F	批发和零售业	1,885,000.00	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	1,015,875.00	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,605,363.95	0.92
J	金融业	17,784,200.00	6.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,291,150.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	3,684,800.00	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	77,159,165.39	27.20

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	60,000	5,251,200.00	1.85
2	600690	海尔智家	250,000	4,875,000.00	1.72
3	600519	贵州茅台	4,000	4,732,000.00	1.67
4	002311	海大集团	110,000	3,960,000.00	1.40
5	603259	药明康德	40,000	3,684,800.00	1.30
6	600741	华域汽车	140,000	3,638,600.00	1.28
7	000858	五粮液	27,000	3,591,270.00	1.27
8	601939	建设银行	480,000	3,470,400.00	1.22
9	601318	中国平安	40,000	3,418,400.00	1.20
10	601888	中国国旅	37,000	3,291,150.00	1.16
11	600585	海螺水泥	59,927	3,283,999.60	1.16
12	601288	农业银行	800,000	2,952,000.00	1.04
13	600837	海通证券	180,000	2,782,800.00	0.98
14	600036	招商银行	70,000	2,630,600.00	0.93
15	000651	格力电器	40,000	2,623,200.00	0.92
16	600028	中国石化	500,000	2,555,000.00	0.90
17	601186	中国铁建	250,000	2,535,000.00	0.89
18	600030	中信证券	100,000	2,530,000.00	0.89
19	600104	上汽集团	100,000	2,385,000.00	0.84
20	601088	中国神华	130,000	2,372,500.00	0.84
21	600050	中国联通	400,000	2,356,000.00	0.83
22	601668	中国建筑	400,000	2,248,000.00	0.79
23	601933	永辉超市	250,000	1,885,000.00	0.66
24	300463	迈克生物	40,000	1,078,800.00	0.38
25	600009	上海机场	12,900	1,015,875.00	0.36
26	600309	万华化学	15,000	842,550.00	0.30
27	688123	聚辰股份	5,550	322,566.00	0.11

28	688366	昊海生科	2,711	216,283.58	0.08
29	688181	八亿时空	3,588	157,800.24	0.06
30	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.05
31	688078	龙软科技	2,811	117,921.45	0.04
32	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.03
33	688310	迈得医疗	3,276	88,845.12	0.03
34	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
35	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
36	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601888	中国国旅	4,773,783.00	9.37
2	600276	恒瑞医药	4,562,042.00	8.96
3	600519	贵州茅台	4,464,787.00	8.77
4	600690	海尔智家	4,434,153.00	8.71
5	000858	五粮液	4,256,797.00	8.36
6	601318	中国平安	3,530,406.00	6.93
7	002311	海大集团	3,527,037.00	6.93
8	600741	华域汽车	3,414,183.00	6.70
9	600837	海通证券	3,352,338.00	6.58
10	600050	中国联通	3,329,265.00	6.54
11	603259	药明康德	3,287,141.00	6.45
12	601939	建设银行	3,013,400.00	5.92
13	600030	中信证券	2,797,482.00	5.49
14	000651	格力电器	2,784,941.00	5.47
15	601288	农业银行	2,720,000.00	5.34
16	601933	永辉超市	2,608,987.00	5.12
17	600028	中国石化	2,483,451.00	4.88
18	600036	招商银行	2,461,411.00	4.83
19	600104	上汽集团	2,454,275.00	4.82
20	601088	中国神华	2,447,662.00	4.81
21	600585	海螺水泥	2,366,752.31	4.65
22	002352	顺丰控股	2,315,219.60	4.55

23	000401	冀东水泥	2,308,076.00	4.53
24	601186	中国铁建	2,282,500.00	4.48
25	600004	白云机场	2,256,795.00	4.43
26	601668	中国建筑	2,212,000.00	4.34
27	601727	上海电气	1,768,804.67	3.47
28	300463	迈克生物	1,156,970.00	2.27
29	300633	开立医疗	1,080,810.00	2.12

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002352	顺丰控股	2,429,606.00	4.77
2	600004	白云机场	2,144,447.00	4.21
3	000401	冀东水泥	1,996,717.00	3.92
4	688111	金山办公	1,959,937.40	3.85
5	601727	上海电气	1,742,382.86	3.42
6	601888	中国国旅	1,643,630.00	3.23
7	300633	开立医疗	997,467.00	1.96
8	600600	青岛啤酒	972,265.00	1.91
9	002714	牧原股份	941,329.00	1.85
10	600050	中国联通	925,931.00	1.82
11	000858	五粮液	852,774.00	1.67
12	688363	华熙生物	850,280.27	1.67
13	002124	天邦股份	787,252.00	1.55
14	002157	正邦科技	784,189.00	1.54
15	600548	深高速	750,437.00	1.47
16	600837	海通证券	746,540.00	1.47
17	600900	长江电力	651,824.00	1.28
18	000568	泸州老窖	584,515.00	1.15
19	601336	新华保险	582,642.00	1.14
20	600887	伊利股份	571,498.00	1.12

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	103,127,872.04
卖出股票收入（成交）总额	37,973,517.05

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	98,706,339.80	34.79
	其中：政策性金融债	78,568,339.80	27.69
4	企业债券	81,164,000.00	28.61
5	企业短期融资券	20,039,000.00	7.06
6	中期票据	20,937,000.00	7.38
7	可转债（可交换债）	22,470,473.90	7.92
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	243,316,813.70	85.77

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180205	18 国开 05	200,000	21,676,000.00	7.64
2	112729	18 申宏 02	200,000	20,772,000.00	7.32
3	180210	18 国开 10	200,000	20,514,000.00	7.23
4	143645	18 电投 02	200,000	20,404,000.00	7.19
5	190207	19 国开 07	200,000	20,148,000.00	7.10

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本基金本报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资前十名股票未超出基金合同规定的股票库。

8.12.3 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	25,292.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,085,600.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,110,893.07

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132015	18 中油 EB	9,420,200.00	3.32
2	132007	16 凤凰 EB	9,355,800.00	3.30
3	113011	光大转债	1,485,947.20	0.52

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
国寿安保稳泰一年定开混合 A	161	1,230,825.91	191,884,935.15	96.83%	6,278,036.60	3.17%
国寿安保稳泰一年定开混合 C	288	208,567.75	43,868,014.50	73.03%	16,199,497.28	26.97%
合计	449	575,123.57	235,752,949.65	91.30%	22,477,533.88	8.70%

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	国寿安保稳泰一年定开混合 A	-	-
	国寿安保稳泰一年定开混合 C	2,061.86	0.0008%
	合计	2,061.86	0.0008%

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 研究部门负责人持有本开放式基金	国寿安保稳泰一年定开混合 A	0~10
	国寿安保稳泰一年定开混合 C	0~10
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保稳泰一年定开混合 A	0~10
	国寿安保稳泰一年定开混合 C	0~10
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保稳泰一年 定开混合 A	国寿安保稳泰一年 定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 8 月 22 日）基金 份额总额	117,457,051.27	372,048,508.49
本报告期期初基金份额总额	20,564,918.56	29,536,666.86
本报告期期间基金总申购份额	188,428,490.68	43,868,491.64
减:本报告期期间基金总赎回份额	10,830,437.49	13,337,646.72
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	198,162,971.75	60,067,511.78

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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、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、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	
太平洋证券	1	96,736,078.49	72.92%	61,070.98	66.81%	-
中信证券	2	23,587,856.57	17.78%	21,967.62	24.03%	-
安信证券	2	10,395,177.60	7.84%	6,562.42	7.18%	-
国泰君安	2	1,936,183.00	1.46%	1,803.11	1.97%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

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》（证监基金[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、

研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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
太平洋证券	121,049,445.88	60.77%	1,025,100,000.00	88.41%	-	-
中信证券	10,722,094.91	5.38%	-	-	-	-
安信证券	24,152,402.45	12.12%	125,000,000.00	10.78%	-	-
国泰君安	375,506.91	0.19%	-	-	-	-
银河证券	42,902,370.80	21.54%	-	-	-	-
长江证券	-	-	9,400,000.00	0.81%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
2	国寿安保部分基金新增众升财富为销售机构的公告	中证报及公司网站	2019 年 2 月 19 日

3	关于旗下基金新增东海证券为销售机构并参加费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019年3月25日
4	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金 2018 年度报告	中证报及公司网站	2019年3月30日
5	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2019年第1号）	中证报及公司网站	2019年4月4日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	中证报及公司网站	2019年4月11日
7	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中证报及公司网站	2019年4月22日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	中证报及公司网站	2019年5月17日
9	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	中证报及公司网站	2019年6月27日
10	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019年6月27日
11	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中信证券费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019年7月3日
12	国寿安保基金公司关于旗下基金新增中山证券为销售机构并参加费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019年7月17日
13	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券有限责任公司为销售机构的公告	中证报及公司网站	2019年7月30日
14	国寿安保稳泰一年定期开放混合基金第二个开放期开放申赎、转换业务公告	中证报及公司网站	2019年8月20日
15	关于旗下基金参加申万宏源、申万宏源西部费率优惠的公告	中证报及公司网站	2019年9月17日
16	国寿安保稳泰一年定期开放	中证报及公司网站	2019年9月27日

	混合型证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2019 年第 2 号）		
17	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加方德保险代理有限公司费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 10 月 17 日
18	国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中证报及公司网站	2019 年 10 月 23 日
19	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加华瑞保险销售有限公司费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 11 月 22 日
20	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 12 月 3 日
21	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加和耕传承基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 12 月 12 日
22	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西藏东方财富证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 12 月 26 日
23	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 12 月 31 日
24	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国工商银行股份有限公司“2020 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中证报及公司网站	2019 年 12 月 31 日

§ 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	20190826~20191231	0.00	94,214,245.34	0.00	94,214,245.34	36.48%
	2	20190826~20191231	0.00	94,214,245.34	0.00	94,214,245.34	36.48%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金募集的文件

13.1.2 《国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》

13.1.3 《国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

13.2 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

13.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfoods.com.cn

13.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2020年4月30日