

信息披露 Disclosure

国寿安保聚宝盆货币市场基金

【2015】半年度报告摘要

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.8.5 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2015年03月02日(合同生效日)~2015年06月30日	上期2014年12月31日
国寿安保聚宝盆货币市场基金	1,224,786,101.81	10,466,286.18

注：本基金的银行存款由基金托管人国寿安保基金管理有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在本承销期内直接通过关联方购入证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 利润分配情况

6.4.9.1 利润分配情况——货币市场基金

单位：人民币元

已按再投资形式支付	直接通过应付赎回款转出	本年变动	应付利润	本期利润分配合计	备注
9,193,023.99	-	148,469.23	-	9,341,493.22	

6.4.10 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 期末债券正回购及作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金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。

7.1 期末投资组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	-	-
2	权益投资	-	-
3	资产支持证券	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,224,786,101.81	99.87
7	其他资产	1,592,754.99	0.13
8	合计	1,226,378,856.80	100.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券投资余额	-	-
2	报告期末股票投资余额	-	-
3	报告期末资产支持证券投资余额	-	-
4	报告期末买入返售金融资产余额	-	-
5	其中：买断式回购余额	-	-

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券投资余额	-	-
2	报告期末股票投资余额	-	-
3	报告期末资产支持证券投资余额	-	-
4	报告期末买入返售金融资产余额	-	-
5	其中：买断式回购余额	-	-

注：本基金报告期内债券投资余额占基金资产净值的比例与报告期末每个交易日基金资产净值比例的平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%。

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	0
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	0
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期末投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”，报告期内本基金未发生超标情况。

7.3.2 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	99.93	-
2	30天(含)-60天	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
6	397天以上	-	-
合计		99.93	-

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	99.93	-
2	30天(含)-60天	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
6	397天以上	-	-
合计		99.93	-

7.4 期末按投资组合品种的基金投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 “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%-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-
报告期内偏离度的最低值	-
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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，每日计提损益。本基金采用固定份额净值，基金账面份额净值始终维持为1.00元。

7.8.2 本基金本报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值的20%的情况。

7.8.3 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.8.4 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	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,754.99

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,585,734.59
5	应收申购款	7,020.40
6	其他应收款	-
7		