国寿安保增金宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2018年8月24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。本半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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国寿安保增金宝货币
基金主代码	001826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月23日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,820,784,848.45份
基金合同存续期	不定期

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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬	朱巍
	联系电话	010-50850744	0571-87659806
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	zhuwei@zbank.com
客户服务电话		4009-258-258	95527
传真		010-50850776	0571-87658688

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	288,575,525.25
本期利润	288,575,525.25
本期净值收益率	2.0788%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末基金资产净值	6,820,784,848.45
期末基金份额净值	1.0000

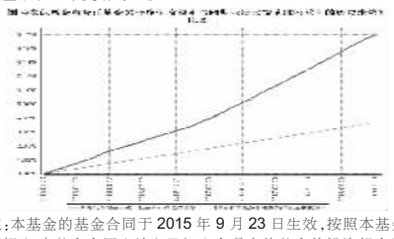
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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
过去一个月	0.2856%	0.0018%	0.1110%	0.0000%	0.1746%	0.0018%
过去三个月	0.9802%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.6436%	0.0020%
过去六个月	2.0788%	0.0018%	0.6695%	0.0000%	1.4093%	0.0018%
过去一年	4.2656%	0.0022%	1.3500%	0.0000%	2.9156%	0.0022%
自基金合同生效起至今	10.1692%	0.0038%	3.7393%	0.0000%	6.4299%	0.0038%

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



注:本基金的基金合同于2015年9月23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9月23日至2018年6月30日。

§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6月30日,公司共管理44只开放式基金及部分特定资产管理计划,公司管理资产总规模为1,880.78亿元,其中公募基金管理规模为1,447.06亿元。

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		
黄力	基金经理	2015年9月23日	-	8年	黄力先生,硕士,中国籍。曾任中国人寿资产管理有限公司投资经理助理;现任国寿安保增金宝货币市场基金、国寿安保安裕半年定期开放债券型发起式证券投资基金及国寿安保安盛纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
张英	基金经理	2017年10月31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

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合法合规,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 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《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。

4.3.2 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

上半年国内宏观经济整体较为平稳,年初在基建带动下,工业增加值和固定资产投资整体较强;二季度基建投资力度有所减弱,商品房销售面积同比回落,工业企业利润增速也有一定下降,消费出现边际走弱迹象,但制造业投资较为稳定,且在土地购置等房地产投资的主要支撑下,投资增速并未出现明显下行。资管新规发布,表内信贷规模维持高位,但表外融资急剧收缩导致社融增速显著下降,实体经济融资难度增大。贸易战加剧,金融市场风险偏好下降,信用利差走扩。上半年央行三次降准,货币政策基调从稳健中性逐步转为偏宽松。除缴税和月末的个别时点外,上半年流动性整体趋向宽松,3个月国有股份制存单收益率从年初的4.8%-4.9%下降至半年末的3.6%附近。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,上半年稳健操作,以投资价值较高的同业存款和存单为主,整体维持了中性适度的杠杆水平,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,保证组合收益平稳。

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2.0788%,业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年美国等发达经济体预计将继续复苏,通胀压力下年内美联储大概率将继续加息两次。贸易战短期内缓和的空间有限,出口可能面临一定压力。实体经济融资受限,下半年房地产和制造业投资增速面临压力。在宽财政的带动下,基建将可能发力托底经济。整体而言国内经济存在一定内生性边际走弱的概率。预计下半年货币政策仍将保持合理充裕,流动性整体维持偏宽松。本基金将坚持谨慎操作的风格,继续强化风险控制,在确保组合安全性和流动性的前提下,密切关注各项宏观数据、政策调整和资金面情况,保持合理的流动性资产配置,应对组合规模波动,努力为投资人创造安全稳定的收益。

4.6 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历。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。

4.7 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288,575,525.25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,本基金托管人在对国寿安保增金宝货币市场基金的托管过程中,严格遵守《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,国寿安保增金宝货币市场基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在国寿安保增金宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、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。本报告期内,国寿安保增金宝货币市场基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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增金宝货币市场基金2018年半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复核,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国寿安保增金宝货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,486,683,714.11	3,904,118,050.36
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,605,895,688.82	6,521,741,777.42
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,605,895,688.82	6,521,741,777.42
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	112,960,296.48	441,295,701.96
应收证券清算款	-	-
应收利息	38,941,966.22	46,860,126.11
应收股利	-	-
应收申购款	4,917,858.43	12,774,293.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,249,399,524.06	10,926,789,949.61
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30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	420,085,169.87	1,033,941,609.08
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,702,095.39	2,012,712.28
应付托管费	1,080,838.16	805,084.93
应付销售服务费	2,702,095.39	2,012,712.28
应付交易费用	125,998.27	93,692.62
应交税费	23,332.58	-
应付利息	175,414.28	696,109.33
应付利润	1,418,782.45	3,722,053.67
递延所得税负债	-	-
其他负债	300,949.22	504,000.00
负债合计	428,614,675.61	1,043,787,974.19
所有者权益:		
实收基金	6,820,784,848.45	9,883,001,975.42
未分配利润	-	-
所有者权益合计	6,820,784,848.45	9,883,001,975.42
负债和所有者权益总计	7,249,399,524.06	10,926,789,949.61

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额为6,820,784,848.45份。

6.2 利润表

会计主体:国寿安保增金宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	345,329,443.23	25,479,959.49
1.利息收入	338,194,792.86	24,866,035.14
其中:存款利息收入	114,903,484.33	15,947,951.30
债券利息收入	210,169,028.88	6,596,987.15
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	13,122,279.65	2,321,096.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	7,134,650.37	613,924.35
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,134,650.37	613,924.35
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	56,753,917.98	4,711,933.25
1. 管理人报酬	17,464,623.40	1,322,569.47
2. 托管费	6,985,849.32	529,027.80
3. 销售服务费	17,464,623.40	1,322,569.47
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	14,603,855.23	1,340,794.18
其中:卖出回购金融资产支出	14,603,855.23	1,340,794.18
6. 税金及附加	8,239.71	-
7. 其他费用	226,726.92	196,972.33
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	288,575,525.25	20,768,026.24
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	288,575,525.25	20,768,026.24

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国寿安保增金宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	9,883,001,975.42	-	9,883,001,975.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	288,575,525.25	288,575,525.25
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)	-3,062,217,126.97	-	-3,062,217,126.97
其中:1.基金申购款	93,957,741,491.83	-	93,957,741,491.83
2.基金赎回款	-97,019,958,618.80	-	-97,019,958,618.80
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)	-	-288,575,525.25	-288,575,525.25
五、期末所有者权益(基金净值)	6,820,784,848.45	-	6,820,784,848.45
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	440,216,274.03	-	440,216,274.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,768,026.24	20,768,026.24
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)	843,409,354.56	-	843,409,354.56
其中:1.基金申购款	5,399,595,487.99	-	5,399,595,487.99
2.基金赎回款	-4,556,186,133.43	-	-4,556,186,133.43
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)	-	-20,768,026.24	-20,768,026.24
五、期末所有者权益(基金净值)	1,283,625,628.59	-	1,283,625,628.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保增金宝货币市场基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]1952号文《关于准予国寿安保增金宝货币市场基金注册的的批复》的核准,由国寿安保基金管理有限公司于2015年9月21日至2015年9月24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_A07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9月23日正式生效,首次设立募集规模为310,106,135.96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管理有限公司,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

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增金宝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、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允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的金融工具。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、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。

6.4.2 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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3号《半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。

6.4.3 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6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 营业税、增值税

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,继续免征营业税;

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,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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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")	基金管理人、注册登记机构、直销机构
浙商银行股份有限公司(简称"浙商银行")	基金托管人、基金销售机构
中国人寿保险股份有限公司(简称"中国人寿")	中国人寿保险集团公司(基金管理人的最终控制人)控制的公司

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,464,623.40	1,322,569.47
其中,支付销售机构的客户维护费	10,079,283.76	344,048.08

注:基金管理费每日计提,按月支付。本基金合同生效日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× R/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

R为基金管理费年费率

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,985,849.32	529,027.80

注:基金托管费每日计提,按月支付。本基金合同生效日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× R/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

R为基金托管费年费率

6.4.8.2.3 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6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
浙商银行	16,040,910.35
国寿安保	278,932.46
合计	16,319,842.81
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6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
浙商银行	204,240.27
国寿安保	403,932.82
合计	608,173.09

注:销售服务费每日计提,按月支付。本基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算公式如下:

H=E× R/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

R为该类基金份额的销售服务费率

6.4.8.3 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6月30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
浙商银行	10,255,285.62	-	-	-	10,363,099,000.00	1,162,152.68
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2015年9月23日)持有的基金份额	0.00	0.00
期初持有的基金份额	134,215,238.05	118,781,338.17
期间申购/买入总份额	35,915,143.02	252,568,566.02
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减:期间赎回/卖出总份额	166,349,647.23	220,000,000.00
期末持有的基金份额	3,780,733.84	151,349,904.19
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.06%	11.79%

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 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	-	-	500,076,161.53	5.06%

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行	401,683,714.11	21,813,098.97	38,580.31	2,266.95

注:本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管,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

无。

6.4.9 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
290,878,796.47	-	-2,303,271.22	288,575,525.25	-

6.4.10 期末(2018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的证券。

6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30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420,085,169.87元,是以如下债券作为质押

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
140202	14国开02	2018年7月4日	101.00	669,000	67,566,208.50
160208	16国开08	2018年7月4日	99.12	2,600,000	257,701,378.41
170410	17农发10	2018年7月4日	99.97	1,200,000	119,965,163.26
合计				4,469,000	445,232,750.17

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 投资组合报告

7.1 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	5,605,895,688.82	77.33
	其中:债券	5,605,895,688.82	77.33
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	112,960,296.48	1.56
	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	1,486,683,714.11	20.51
4	其他各项资产	43,859,824.65	0.61
5	合计	7,249,399,524.06	100.00

7.2 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	6.71	
	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	420,085,169.87	6.16
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

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。

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	8.13	6.16
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	12.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	47.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	34.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		105.64	6.16

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%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%情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按实际利率法摊销,每日计提收益或损失。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

|