国寿安保聚宝盆货币市场基金

2018年第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:徽商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)
1. 本期已实现收益	18,894,673.55
2. 本期利润	18,894,673.55
3. 期末基金资产净值	2,016,341,669.92

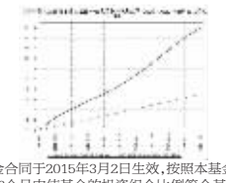
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8050%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.4647%	0.0005%

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3月2日生效,按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为2015年3月2日至2018年12月31日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桑迎	基金经理	2015年3月2日	-	16年	硕士研究生。2002年7月至2003年8月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年11月至2008年1月,任职于华夏银行总行资金部,担任交易员;2008年2月至2013年12月,任职于嘉实基金,历任交易员、基金经理。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保新金宝货币市场基金、国寿安保聚宝盆货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金及国寿安保货币市场基金基金经理。
张英	基金经理	2017年1月5日	-	6年	曾任中国人寿资产管理有限公司固际部研究员。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》、《国寿安保聚宝盆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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度国内宏观经济体现出一定的下行压力,消费疲弱,房地产销售下滑,基建投资增速持续下降。影响债券市场最主要的矛盾是融资需求不足,货币政策从宽货币向宽财政的传导不畅。社会融资规模中,表外融资整体继续收缩,表内信贷规模也低于预期。票据利率在四季度持续下降,也从侧面反映出融资总量成色不足。央行货币政策维持稳健中性基调,10月份降准1个百分点,叠加10月下旬财政投放,银行间流动性极其宽松,但在回购利率下行至一定水平后,央行采取了正回购操作,引导回购利率回购合理水平。整体来说,四季度银行间流动性总体较为充裕,仅在接近年末时点出现阶段性紧张。3个月AAA存单收益率大部分时间在2.8%-3.2%之间波动,年末时点接近3.6%后触顶回落。较长期限的9个月和1年期存单在3.6%-3.5%附近保持较长时间,在11月底后下降至3.4%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,四季度稳健操作,以投资价值较高的同业存款和存单为主,前期维持了较长的剩余期限,并保持适度杠杆,获得了较高的静态收益率。在关键时点把握配置机会,并通过积极交易保证组合的流动性并尽量保持收益平稳。

4.5 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0.8050%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,580,491,239.92	71.20
	其中:债券	1,580,491,239.92	71.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	631,714,719.58	28.46
4	其他资产	7,481,550.27	0.34
5	合计	2,219,687,509.77	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	9.18
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	201,041,378.44	9.97
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	17.43	9.97
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	22.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	18.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	31.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.71	9.97

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	289,867,108.79	14.38
	其中:政策性金融债	289,867,108.79	14.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,290,624,131.13	64.01
8	其他	-	-
9	合计	1,580,491,239.92	78.38
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111807190	18招商银行CD190	1,500,000	147,183,403.29	7.30
2	111812089	18北京银行CD089	1,000,000	99,902,010.25	4.95
1	111894921	18南京银行CD057	1,000,000	99,900,952.17	4.95
4	160208	16国开08	1,000,000	99,752,127.86	4.95
5	111810563	18兴业银行CD563	1,000,000	99,518,350.01	4.94
6	111809388	18浦发银行CD388	1,000,000	99,495,093.25	4.93
7	111820227	18广发银行CD227	1,000,000	99,494,759.72	4.93
8	111804036	18中国银行CD036	1,000,000	99,489,828.81	4.93
9	111815432	18民生银行CD432	1,000,000	99,444,095.17	4.93
10	111818359	18华夏银行CD359	1,000,000	99,381,866.86	4.93

5.7 "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	0.1077%
报告期内偏离度的最低值	-0.0138%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0757%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

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

5.9.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除上海浦东发展银行外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。

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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	7,481,550.27
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,481,550.27

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,652,201,984.21
报告期期间基金总申购份额	1,113,742,251.20
报告期期间基金总赎回份额	1,749,602,565.49
报告期期末基金份额总额	2,016,341,669.92

注:报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2018年12月28日	793,943.52	-	-
合计			793,943.52	-	

注:基金管理人运用固有资金投资本基金皆通过直销机构进行,申购和赎回交易日期指交易申请日;本基金不收取申购费用和赎回费用;本基金每日分配收益并结转为基金份额,上述红利再投资金额为整个报告期内数据之和。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保聚宝盆货币市场基金募集的文件

9.1.2《国寿安保聚宝盆货币市场基金基金合同》

9.1.3《国寿安保聚宝盆货币市场基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保聚宝盆货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,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

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

9.3.3 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
2019年1月19日

国寿安保添利货币市场基金

2018年第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保添利货币
交易代码	003422
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月27日
报告期末基金份额总额	21,711,880,363.13份
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。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国寿安保添利货币A / 国寿安保添利货币B
下属分级基金的交易代码	003422 / 003423
报告期末下属分级基金的份额总额	14,065,258.80份 / 21,697,815,104.33份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月1日 - 2018年12月31日)	
	国寿安保添利货币A	国寿安保添利货币B
1. 本期已实现收益	113,623.15	167,832,315.87
2. 本期利润	113,623.15	167,832,315.87
3. 期末基金资产净值	14,065,258.80	21,697,815,104.33

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 本报告期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

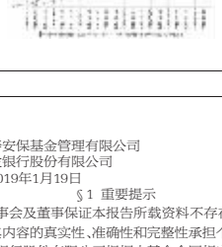
国寿安保添利货币A

阶段	净值收益率①	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	0.6583%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.3180%	0.0007%

国寿安保添利货币B

阶段	净值收益率①	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	0.7194%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.3791%	0.0007%

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2016年12月27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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
桑迎	基金经理	2016年12月27日	-	16年	硕士研究生。2002年7月至2003年8月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年11月至2008年1月,任职于华夏银行总行资金部,担任交易员;2008年2月至2013年12月,任职于嘉实基金,历任交易员、基金经理。2013年12月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保场内实时申赎货币市场基金、国寿安保新金宝货币市场基金、国寿安保聚宝盆货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金及国寿安保货币市场基金基金经理。

注:任职日期为基金合同生效日。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》、《国寿安保添利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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年4季度国内货币政策整体维持合理充裕,同时更加注重区间上下限管理,具体表现为央行货币政策操作仍然具有前瞻性,季度初降准确保货币市场整体流动性处于合理状态,但同时在季度内减少公开市场投放,引导7天回购加权利率保持在公开市场操作利率附近。在央行货币政策这一操作模式下,4季度货币市场利率维持低位窄幅震荡,4季度银行间标志性的7日质押式回购加权利率均价2.83%。在资金面充裕,货币政策稳定的环境下,4季度银行存单发行利率总体维持平稳,3个月期限AAA级存单收益率平均在3.1%附近,仅年底前受跨年资金影响波动增大。货币市场曲线整体呈平坦化下行,期限利差受到较大程度压缩,收益率低位。

4季度,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,结合本基金以机构客户为主的特点,以确保组合流动性、安全性为首要任务;灵活配置债券投资和同业存款,管理现金流,保障组合充足流动性。本基金成功应对了市场和规模的波动,投资业绩平稳,实现了均衡安全性、流动性和收益性的目标,组合的持仓结构、流动性和弹性良好,为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期国寿安保添利货币A的基金份额净值收益率为0.6583%,本报告期国寿安保添利货币B的基金份额净值收益率为0.7194%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	6,434,073,768.93	29.62
	其中:债券	6,434,073,768.93	29.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,937,201,402.91	36.54
	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	7,294,439,900.82	33.58
4	其他资产	58,745,502.97	0.27
5	合计	21,724,460,575.63	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	1.35
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	63
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告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	61.06	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	13.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	3.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	13.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.79	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,111,105,590.27	5.12
	其中:政策性金融债	1,111,105,590.27	5.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,322,968,178.66	24.52
8	其他	-	-
9	合计	6,434,073,768.93	29.63
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111817038	18光大银行CD038	11,000,000	1,096,036,251.25	5.05
2	111806212	18建设银行CD212	8,000,000	794,439,972.63	3.66
3	180201	18国开01	7,400,000	740,939,967.54	3.41
4	111818274	18华夏银行CD274	4,700,000	466,193,501.35	2.15
5	111808224	18中信银行CD224	4,500,000	446,809,033.28	2.06
6	111810518	18兴业银行CD518	4,000,000	398,985,929.25	1.84
7	111816356	18上海银行CD356	3,000,000	298,701,115.76	1.38
8	111820227	18广发银行CD227	3,000,000	298,485,079.23	1.37
9	111809389	18浦发银行CD389	3,000,000	298,484,279.17	1.37
10	160402	16农发02	2,500,000	250,013,883.24	1.15

5.7 "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	0.0178%
报告期内偏离度的最低值	-0.0217%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0097%

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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

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

5.9.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体除上海浦东发展银行外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。

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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	58,695,806.17
4	应收申购款	49,696.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	58,745,502.97

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国寿安保添利货币A	国寿安保添利货币B
报告期期初基金份额总额	18,133,619.10	22,208,114,784.52
报告期期间基金总申购份额	7,551,211.63	19,288,226,430.89
报告期期间基金总赎回份额	11,619,571.93	19,798,526,111.08
报告期期末基金份额总额	14,065,258.80	21,697,815,104.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投资	2018年10月15日	27,310.54	0.00	0.00%
2	红利再投资	2018年11月15日	26,729.31	0.00	0.00%
3	红利再投资	2018年12月17日	28,777.21	0.00	0.00%
合计			82,817.06	0.00	

注:基金管理人运用固有资金投资本基金皆通过直销机构进行,申购和赎回交易日期指交易申请日。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20181001-20181231	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	50.00%
	2	20181001-20181231	199,999,000.00	0.00	0.00	199,999,000.00	50.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
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。							

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准国寿安保添利货币市场基金募集的文件

9.1.2《国寿安保添利货币市场基金基金合同》

9.1.3《国寿安保添利货币市场基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保添利货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,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

9.3 查阅方式

9.3.1营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

9.3.3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
2019年1月19日

国寿安保稳吉混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保稳吉混合
交易代码	004756
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月26日
报告期末基金份额总额	400,014,540.74份
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,在约定的投资比例下,合理配置股票、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,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中债综合(全价)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,属于中高风险/收益的投资品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国寿安保稳吉混合A / 国寿安保稳吉混合C
下属分级基金的交易代码	004756 / 004757
报告期末下属分级基金的份额总额	400,008,716.08份 / 5,824.66份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指