

国寿安保货币市场基金

[2014]第三季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人代表和召集基金份额持有人大会的基金份额持有人代表共同签署并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。

基金合同生效后,基金管理人和基金托管人根据基金合同的约定,于2014年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺诚实守信、勤勉尽责地履行基金的管理义务,但不保证本基金一定盈利。

基金过往业绩并不代表其未来表现,投资需谨慎。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。

本报告期买入2014年7月1日至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国寿安保货币

基金代码 000005

基金运作方式 约定管理型开放式

基金合同生效日 2014年1月20日

报告期末基金资产总额 20,265,500,669.69

投资目标 在保持资产流动性、保证较低风险的前提下,力争为基金份额持有人创造稳定收益。

投资策略 在严格控制风险的前提下,分析和判断利率走势及收益率变化趋势,在综合考虑利率趋势、收益率变化趋势和流动性等情况下,动态调整组合的久期和期限结构,并根据基金资产的配置比例,适时调整股票、债券、货币市场工具的配置比例,以期在控制风险的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准 天天基金货币基金(税后)

风险收益特征 本基金为货币市场基金,是低风险投资品种。本基金通过投资于货币市场工具,力争在保证本金安全的前提下,实现基金资产的长期稳定增值。

基金管理人 国寿安保基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 国寿安保货币A 国寿安保货币B

下属分级基金的交易代码 000005 000006

报告期末下属分级基金的份额总额 327,537,911.09份 19,757,972,082.59份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2014年07月01日-2014年09月30日)

国寿安保货币A 国寿安保货币B

1.本期已实现收益 6,076,523.77 220,946,865.87

2.本期利润 6,076,523.77 220,946,865.87

3.期末基金资产净值 327,537,911.09份 19,757,972,082.59份

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,本期实现收益和本期利润的金额等。

3.2 基金合同生效以来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

3.2.1 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

1.国寿安保货币A

阶段 净值收益率① 0.003% 0.040% 0.000% 0.7680% 0.0023%

2.国寿安保货币B

阶段 净值收益率① 0.002% 0.020% 0.000% 0.8620% 0.0023%

注:本基金每日进行收益分配,并按月转换为基金份额。

3.2.2 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

3.3.1 报告期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 持有成本 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 外币票据 - -

3 金融债券 2,646,466,440.30 13.05

4 其中:政策性金融债 2,646,466,440.30 13.05

5 企业短期融资券 8,205,098,654.75 40.45

6 中期票据 20,124,196.03 0.10

7 其他 - -

8 合计 10,871,680,298.07 53.89

3.3.2 报告期期末按公允价值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 持券数量(张) 持券成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 120229 12国开02 5,000,000 496,207,352.25 2.45

2 110418 11农银18 4,500,000 449,222,317.64 2.22

3 01141507 14农银SCP007 4,000,000 399,805,064.61 1.97

4 011474004 14农银SCP004 4,000,000 399,767,130.68 1.97

5 110402 11农银02 3,800,000 380,013,713.83 1.87

6 071403008 14中农CP008 3,400,000 339,401,364.76 1.68

7 011437005 14建行SCP005 3,000,000 299,513,173.92 1.48

8 011499028 14隆基SCP001 3,000,000 299,807,488.22 1.48

9 071403007 14中行CP007 2,800,000 279,967,855.66 1.38

10 110236 10国开06 2,700,000 270,559,663.19 1.33

3.3.3 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.4 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.5 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.6 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.7 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.8 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.9 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.10 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.11 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.12 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.13 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.14 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.15 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.16 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.17 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.18 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.19 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.20 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.21 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.22 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.23 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.24 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.25 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.26 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.27 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.28 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.29 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.30 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.31 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.32 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.33 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.34 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.35 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.36 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.37 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.38 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.39 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.40 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.41 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.42 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.43 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.44 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.45 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.46 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.47 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.48 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.49 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.50 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.51 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.52 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.53 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.54 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.55 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.56 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.57 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.58 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.59 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.60 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.61 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.62 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.63 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.64 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.65 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.66 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.67 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.68 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.69 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

3.3.70 报告期期末按摊余成本法确定的基金资产净值的偏离