

国寿安保场内实时申赎货币市场基金

[2015]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:2016年1月20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的基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和份额净值等数据,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金类型:货币型基金,净值稳定,风险低,流动性好,适合长期投资。

基金经理:吴力先生,硕士,中国籍,曾任中国平安资产管理有限公司投资经理助理,现任国寿安保货币市场基金基金经理。

基金合同对基金管理人、基金托管人及基金份额持有人的各自权利义务以及基金的募集、运作、申购与赎回、收益分配、估值、信息披露、基金合同的变更、终止与清算等事项作了约定。

本基金的招募说明书已经公告。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国寿安保场内实时申赎货币

交易代码 610978

基金运作方式 货币型开放式

基金合同生效日 2014年10月20日

报告期末基金份额总额 277,192,991,080.00份

报告期基金份额净值 1.00元

投资目标 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

投资策略 本基金将在人民币计价的海外市场中,挑选表现良好的债券,通过资产配置,在货币供应量的基础上,分析利率走势、资金供求变化趋势,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科学配置。

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均低于股票型基金、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 广发银行股份有限公司

报告期未持有基金的基金简称 国寿安保场内实时申赎货币A

报告期未持有基金的交易代码 610978

报告期未持有基金的份额总额 71,633,500,601.00份

报告期未持有基金的份额净值 1.00元

注:本基金份额净值为0.01%。

§ 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(2015年10月1日 - 2015年12月31日)

国寿安保场内实时申赎货币A 0.0000

1. 本期已实现收益 6,541,690.05

2. 本期利润 6,541,690.05

3. 期末基金资产净值 71,633,500,601.00

注:本基金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相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1. 国寿安保场内实时申赎货币A

阶段 阶段一 净值收益率① 0.0323% 收益率标准差② 0.0010%

阶段二 净值收益率① 0.0340% 收益率标准差② 0.0013%

阶段三 净值收益率① 0.0357% 收益率标准差② 0.0014%

阶段四 净值收益率① 0.0365% 收益率标准差② 0.0014%

合计 0.0365% 0.0014%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

图示:国寿安保场内实时申赎货币市场基金成立以来的净值增长率与业绩比较基准收益率的对比情况。

注:本基金的基金合同于2014年10月20日生效。按照基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的总资产合比例符合基金合同“第十二部分(三)投资范围、(五)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间 任期日期 离任日期 说明

吴力 基金经理 2014年10月20日 - 11年 研究生学历,博士研究生,曾任中国平安资产管理有限公司投资经理助理,现任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 管理人对报告期内基金运作遵规守信的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保场内实时申赎货币市场基金合同》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本基金,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作期间不存在损害基金持有人利益的不公平交易行为。

4.3 对公平交易制度执行情况的说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人公平对待所管理的不同基金,不存在不公平对待不同基金的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现存在违法违规且对本基金产生影响的重大异常交易行为;且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同向交易或反向交易且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 报告期内本基金的投研策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金的投研策略和运行动态

2015年10月,随着经济数据回暖,通胀压力降低,多数地区的通胀率呈现底部回升的走势。银行间市场的回购利率

图示:国寿安保场内实时申赎货币市场基金成立以来的收益率走势图。

注:本基金的基金合同于2014年10月20日生效。按照基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的总资产合比例符合基金合同“第十二部分(三)投资范围、(五)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。

4.5 管理人对报告期内基金投资策略和运作分析

4.5.1 投资策略和运作情况

报告期内,本基金严格按照《证券投资基金法》、《国寿安保场内实时申赎货币市场基金合同》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本基金,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金运作期间不存在损害基金持有人利益的不公平交易行为。

4.5.2 报告期内本基金的运作情况

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

4.5.3 报告期内本基金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。

4.5.4 其他资产构成情况

序号 项目 金额(元)

1 存出保证金 19,101,468.00

2 应收证券清算款 999,900.39

3 应收利息 11,036,489.50

4 应收申购款 -

5 其他应收款 -

6 持有的待购入证券 -

7 其他 -

8 合计 31,136,037.98

注:报告期内本基金总份额的基金资产净值比例为0.01%。

4.6 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.1 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.2 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.3 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.4 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.5 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.6 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.7 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.8 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.9 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.10 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.11 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.12 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.13 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.14 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.15 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.16 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.17 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.18 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.19 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.20 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.21 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.22 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.23 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.24 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.25 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.26 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.27 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.28 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.29 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.30 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.31 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.32 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.33 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.34 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.35 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.36 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.37 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.38 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.39 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.40 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.41 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.42 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.43 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.44 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.45 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.46 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.47 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.48 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.49 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.50 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.51 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.52 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.53 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.54 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.55 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.56 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.57 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.58 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.59 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.60 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.61 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.62 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.63 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.64 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.65 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明

4.6.66 报告期内本基金有买入权或卖出权的基金资产净值情况说明