国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保强国智造灵活配置混合
交易代码	003131
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月27日
报告期末基金份额总额	312,433,306.37份
投资目标	本基金通过挖掘中国经济结构转型和产业升级大背景下,强国智造主题相关行业的投资机会,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票及债券投资外,本基金还可通过投资衍生工具等,进一步为基金组合规避风险、增强收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高收益/风险品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	10,797,225.62
2.本期利润	17,635,440.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.0487
4.期末基金资产净值	325,063,402.94
5.期末基金份额净值	1.0404

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。

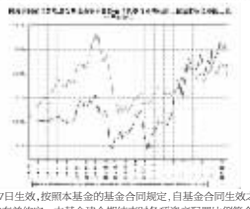
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	4.65%	0.56%	2.51%	0.31%	2.14%	0.25%

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



注:本基金的基金合同于2016年9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。图示日期为2016年9月27日至2017年3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		
李捷	基金经理	2016年9月27日	-	10年	李捷先生,硕士。曾任德勤华永会计师事务所高级审计师,中国国际金融有限公司分析员,财富里昂证券有限责任公司投资分析师。2013年12月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。现任国寿安保保本混合型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金及国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张琦	股票投资部总经理、基金经理	2016年9月27日	-	12年	2005年1月至2015年5月,任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理,基金经理等职,2015年6月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保基金管理有限公司股票投资部总经理,国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金及国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 管理人对投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》、《国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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

1、市场回顾

2017年一季度,A股市场先抑后扬,指数继续分化明显,上证综指罕计小幅上涨3.83%,创业板综指下跌2.51%。一季度涨幅居前的行业为家电、食品饮料、国防军工、建筑装饰、建材等;一季度跌幅居前的行业为传媒、农林牧渔、纺织服装、商业贸易等。综合来看,盈利确定性较低或者估值相对较高的行业持续受到挤压。未来一阶段,我们认为,市场仍可能延续对于盈利预期和成长确定性的偏好,具备价值和持续成长性的行业和公司有望持续跑赢市场。

2、运作分析

2017年一季度,国寿安保强国智造基金仍处于成立之后的建仓期,在市场相对低迷的阶段积极把握市场机会,提高了权益仓位的比例。目前,基金组合的配置整体偏向制造业,并兼顾了蓝筹和成长的风格。在行业配置上,配置比例相对较高的有机械设备、化工、轻工制造、家电、电气设备、医药生物等。截至2017年3月31日,基金组合中持有的股票市值占资产净值比例为83.34%,持有的债券市值比例为5.17%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日为止,本基金的单位净值为1.0404元,本基金的累计单位净值为1.0404元。季度内本基金份额净值增长率为4.65%,同期业绩比较基准收益率为2.51%。

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	权益投资	270,908,378.53	81.93
	其中:股票	270,908,378.53	81.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,808,400.00	5.08
	其中:债券	16,808,400.00	5.08
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	22,000,000.00	6.65
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,602,780.62	6.23
8	其他资产	341,093.19	0.10
9	合计	330,660,652.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,785,120.00	4.24
C	制造业	218,534,124.31	67.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,440,432.50	2.29
F	批发和零售业	4,669,184.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	75,187.56	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,694,400.00	2.37
J	金融业	11,344,800.00	3.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,087,400.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,260,800.00	0.70
S	综合	-	-
	合计	270,908,378.53	83.34

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期未未持有沪港通投资股票投资组合

5.3 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000521	美菱电器	2,063,730	14,735,032.20	4.53
2	000157	中联重科	2,080,000	9,942,400.00	3.06
3	600966	博汇纸业	1,800,000	9,234,000.00	2.84
4	600315	上海家化	239,917	7,233,497.55	2.23
5	002465	海格通信	600,000	7,044,000.00	2.17
6	600320	振华重工	1,205,930	6,970,275.40	2.14
7	300011	鼎汉技术	350,000	6,720,000.00	2.07
8	600970	中材国际	620,000	6,634,000.00	2.04
9	600894	广日股份	480,000	6,460,800.00	1.99
10	600160	巨化股份	560,000	6,277,600.00	1.93

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,996,400.00	1.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	9,979,000.00	3.07
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	833,000.00	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,808,400.00	5.17

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011698866	16许继SCP001	100,000	9,979,000.00	3.07
2	019539	16国债11	60,000	5,996,400.00	1.84
3	113011	光大转债	5,000	500,000.00	0.15
4	113012	骆驼转债	3,330	333,000.00	0.10

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内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。

5.11.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	108,890.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	231,004.74
5	应收申购款	1,198.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	341,093.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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	394,684,706.70
报告期期间基金总申购份额	179,831.67
减:报告期期间基金总赎回份额	82,431,232.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	312,433,306.37

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情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

§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	20170101-20170331	130,004,850.00	-	-	130,004,850.00	41.61%
-	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-
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强国智造灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内国寿安保强国智造灵活配置混合型证券投资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
2017年4月22日

国寿安保薪金宝货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保薪金宝货币
交易代码	000895
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月20日
报告期末基金份额总额	11,346,988,164.09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	中信银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	77,969,721.80
2. 本期利润	77,969,721.80
3. 期末基金资产净值	11,346,988,164.09

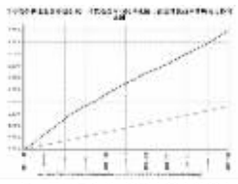
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	0.9161%	0.0021%	0.3329%	0.0000%	0.5832%	0.0021%

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2014年11月20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2014年11月20日至2017年3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	2014年11月20日	-	13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、国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保聚宝益货币市场基金、国寿安保鑫钱包货币市场基金及国寿安保添利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 管理人对投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》、《国寿安保薪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 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

2017年1季度货币市场走势整体偏紧。宏观经济方面,国内经济数据走势较为平稳,货币政策执行取向日趋向着防风险控杠杆方面转变。随着国内外经济政治形势变化,人民币汇率以及资本流动压力暗流涌动。3月美联储升息后人民银行也相应提高了公开市场操作利率等一系列指标利率水平。1季度货币市场流动性偏紧,特别是银行间市场非银机构资金成本快速上行。存单供给量大幅增加、季度末MPA考核等因素影响着货币市场。货币市场利率始终维持在高位,1季度银行间7日质押式回购加权利率均价3.04%,3月跨季度资金的融资成本高达5%以上,甚至还有8%以上的成交。随着资金成本的抬高,存单、现券等收益率也随之高位运行。3个月AAA级别银行存单收益率维持在4%以上,极端时甚至一级市场发行利率达到4.6%以上。总体而言,2017年1季度是货币市场流动性偏紧,各项监管政策呼之欲出的一个季度。

1季度,本基金秉持稳健投资原则,谨慎操作,结合本基金以零售客户为主的特点,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

本报告期内,本基金基金份额净值收益率为0.9161%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

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	3,141,653,074.70	25.07
	其中:债券	3,141,653,074.70	25.07
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,154,647,251.96	9.21
	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	7,974,517,884.30	63.63
4	其他资产	262,793,714.34	2.10
5	合计	12,533,611,925.30	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	7.31	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,178,390,552.41	10.39
	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	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

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	17.62	10.39
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.41	-
2	30天(含)-60天	13.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.70	-
3	60天(含)-90天	39.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.44	-
4	90天(含)-120天	3.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	34.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		108.14	10.39

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

本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	968,154,434.18	8.53
	其中:政策性金融债	968,154,434.18	8.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,173,498,640.52	19.15
8	其他	-	-
9	合计	3,141,653,074.70	27.69
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	288,059,805.43	2.54

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	120233	12国开33	2,000,000	200,030,235.91	1.76
2	111790824	17包商银行CD007	2,000,000	199,338,959.75	1.76
3	130234	13国开34	1,600,000	159,685,294.56	1.41
4	111792423	17唐山银行CD029	1,500,000	149,036,116.40	1.31
5	150224	15国开24	1,000,000	100,014,480.46	0.88
6	111610286	16兴业CD286	1,000,000	100,000,000.00	0.88
7	130212	13国开12	1,000,000	99,969,558.47	0.88
8	130216	13国开16	1,000,000	99,884,684.03	0.88
9	111699005	16廊坊银行CD004	1,000,000	99,681,162.56	0.88
10	111711083	17平安银行CD083	1,000,000	99,330,769.05	0.88

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0761%
报告期内偏离度的最低值	-0.0544%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0419%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内,本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内,本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

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

本基金本报告期末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 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、处罚的情形。

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	61,657,808.86
4	应收申购款	201,135,905.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	262,793,714.34

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	6,056,426,484.40
报告期期间基金总申购份额	22,636,954,198.66
报告期期间基金总赎回份额	17,346,392,518.97
报告期期末基金份额总额	11,346,988,164.09

§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	2017年3月31日	72,90153	-	-
合计			72,90153	-	

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

8.1.1 中国证监会批准国寿安保薪金宝货币市场基金募集的文件

8.1.2《国寿安保薪金宝货币市场基金基金合同》

8.1.3《国寿安保薪金宝货币市场基金托管协议》

8.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

8.1.5 报告期内国寿安保薪金宝货币市场基金在指定媒体上披露的各项公告

8.1.6 中国证监会要求的其他文件

8.2 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

8.3 查阅方式

8.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

8.3.2登录本公司网站查阅基金产品相关信息:www.gsfunds.com.cn

8.3.3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
2017年4月22日

国寿安保智慧生活股票型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保智慧生活股票
交易代码	001672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月1日
报告期末基金份额总额	536,080,065.57份
投资目标	本基金在深入研究的基础上,自下而上精选开拓和建设智慧生活的上市公司,在严格控制投资风险的前提下,力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	在大类资产配置上,在具备足够多本基金所定义的投资标的时,优先考虑股票类资产的配置,剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票投资策略外,本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略,进一步为基金组合规避风险、增强收益。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势,评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险,据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例,在保持总体风险水平相对稳定的基础上,力争投资组合的稳定增值。在债券类资产的投资上,将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率X80%+中债综合指数收益率(全价)X20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,属于证券投资基金中的高风险/高收益品种。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	-6,916,466.32
2.本期利润	43,693,625.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0871
4.期末基金资产净值	613,010,612.42
5.期末基金份额净值	1.144

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。

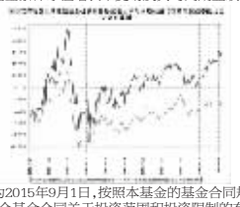
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	8.06%	0.66%	3.27%	0.41%	4.79%	0.25%

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



注:本基金基金合同生效日为2015年9月1日,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