

国寿安保聚宝盆货币市场基金

【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:徽商银行股份有限公司
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法律责任。
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预示其未来表现。投资者有风险,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	国寿安保聚宝盆货币
交易代码	001006
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年03月21日
报告期末基金份额总额	3,034,739,280.89份
投资目标	在严格控制风险和保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投资回报。
投资策略	本基金将在深入研判国内外宏观经济走势、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,采取利率债、信用债、可转债等固定收益类资产,并综合考虑各类资产的收益性、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,属于证券投资基金中的低风险品种。本基金的投资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

3.1 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	20,709,368.58
2. 本期利润	20,709,368.58
3. 期末基金资产净值	3,034,739,390.89

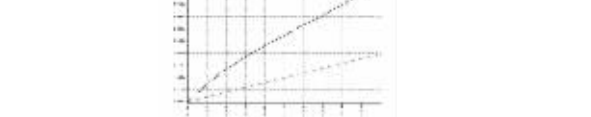
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去三个月	0.0706%	0.0303%	0.0403%	0.0437%

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3月21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。本基金建仓期间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3月2日至2017年3月31日。

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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
康迎	基金经理	2016年3月21日	13年	硕士研究生,2002年7月至2003年1月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年1月至2008年11月,任职于华夏银行总行资产管理部,担任交易员;2008年12月至2013年12月,任平安基金基金、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,历任国寿安保货币市场基金、国寿安保鑫鑫货币市场基金、国寿安保鑫鑫货币市场基金及国寿安保鑫鑫货币市场基金基金经理。
张英	基金经理	2017年1月15日	6年	曾任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员,2016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。现任国寿安保鑫鑫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,本着诚实信用、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投资基金限制行为对基金份额持有人的利益。

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超过该证券当日成交量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,货币政策执行取向谨慎,央行流动性调控力度偏紧。随着国内外经济政治形势变化,人民币汇率及资本流动出现波动,3月美联储升息后人民币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。存单供给量大增,季末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约3.04%,3月跨季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策略,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;灵活运用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预期的波动,投资业绩平稳,实现了均衡安全、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 报告期内基金的投资表现

本报告期内,本基金基金份额净值收益率为30.766%,同期业绩比较基准收益率为3.3329%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值变动说明

5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	固定收益投资	518,560,475.48	17.08
	其中:债券	518,560,475.48	17.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	836,489,334.73	27.58
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和到期资产合计	1,667,876,177.73	54.93
4	其他资产	13,707,676.89	0.45
5	合计	3,036,632,664.83	100.00

5.2 报告期末债券回购融资情况

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: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法律责任。
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预示其未来表现。投资者有风险,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。
本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

截至公告日期2017年1月1日起截至2016年3月31日止。

基金名称

基金简称

基金代码

基金运作方式

基金合同生效日

报告期末基金份额总额

投资目标

投资策略

业绩比较基准

风险收益特征

基金管理人

基金托管人

3.1 主要财务指标

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	3,660,698.80
2. 本期利润	3,660,698.80
3. 期末基金资产净值	541,150,601.10

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

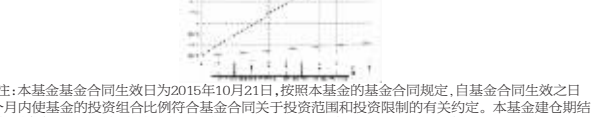
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去三个月	0.0727%	0.0322%	0.0405%	0.0464%

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:本基金基金合同生效日为2016年10月21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。本基金建仓期间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10月21日至2017年3月31日。

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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
康迎	基金经理	2016年10月21日	13年	硕士研究生,2002年7月至2003年1月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年1月至2008年11月,任职于华夏银行总行资产管理部,担任交易员;2008年12月至2013年12月,任平安基金基金、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,历任国寿安保货币市场基金、国寿安保鑫鑫货币市场基金、国寿安保鑫鑫货币市场基金及国寿安保鑫鑫货币市场基金基金经理。

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		0.28
	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	报告期内债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:本基金报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期末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
本基金本报告期未进行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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

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	33.89	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	2.63	-
2	30天(含)-60天	18.70	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	33.63	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	5.26	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	1.06	-
5	120天(含)-397天(含)	8.14	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
合计	-	99.61	-

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	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	209,513,063.28	0.67
	其中:政策性金融债	209,513,063.28	0.67
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	29,592,524.14	0.09
6	中期票据	-	-
7	同业存单	189,054,488.06	0.62
8	其他	-	-
9	合计	518,560,475.48	1.70
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债	139,520,185.46	0.46

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	120323	12国债33	1,000,000	100,041,517.98	3.30
2	120324	12国债34	800,000	79,980,884.93	2.63
3	120227	12国债27	600,000	59,569,300.53	1.96
4	111610280	16兴业CD280	500,000	50,009,782.53	1.65
5	111680551	16广农发行CD091	500,000	49,696,026.00	1.64
6	111793159	17长安银行CD017	500,000	49,588,269.61	1.63
7	070209	07国债09	400,000	39,941,061.98	1.32
8	111680788	16民生银行CD097	400,000	39,790,379.92	1.31
9	01168554	16兴业债CD3007	200,000	19,993,820.26	0.66
10	120408	12农发债	100,000	10,009,340.04	0.33

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

阶段	净值收益率①	摊余成本法②	①-②	③-④
过去三个月	0.0740%	0.0011%	0.0339%	0.0000%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值
报告期内偏离度的最大值
报告期内偏离度的最小值
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

报告期内每个工作日偏离度的绝对值达到0.25%以上、0.5%的情况说明
本基金本报告期内未发生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%的情况说明
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

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。本基金采用固定价摊销法,基金账面份额净值始终维持1.00元。

5.9.2 报告期内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。

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	13,707,676.89
4	应收申购款	330,877.69
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,707,676.89

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

项目	基金份额(份)
报告期初基金份额总额	1,339,151,104.41
报告期内基金份额总额增加	8,220,867,036.06
报告期末基金份额总额	7,126,278,848.58

注:报告期内基金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转出份额。

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	买入	2017年3月31日	38,062.06	-	-
合计	买入	2017年3月31日	38,062.06	-	-

注:基金管理人运用固有资金投资本基金通过直销机构进行,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聚宝盆货币市场基金募集的文件
8.1.2 《国寿安保聚宝盆货币市场基金基金合同》
8.1.3 《国寿安保聚宝盆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 报告期内国寿安保聚宝盆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 登录本公司网站查询基金产品相关信息:www.gsfund.com.cn
8.3.3 拨打本公司客户服务电话查询:4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司
2017年4月22日

国寿安保添利货币市场基金

【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:交通银行股份有限公司
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法律责任。
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预示其未来表现。投资者有风险,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。
本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

基金简称	国寿安保添利货币	
交易代码	000422	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2016年12月27日	
报告期末基金份额总额	12,285,671,663.31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投资回报。	
投资策略	本基金将在深入研判国内外宏观经济走势、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,采取利率债、信用债、可转债等固定收益类资产,并综合考虑各类资产的收益性、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,属于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	
下属分属基金的基金简称	国寿安保添利货币A	国寿安保添利货币B
下属分属基金的交易代码	000422	000423

3.1 主要财务指标

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	13,552.78	52,649,996.72
2. 本期利润	13,552.78	52,649,996.72
3. 期末未分配利润	3,197,200,639	12,282,374,463.69

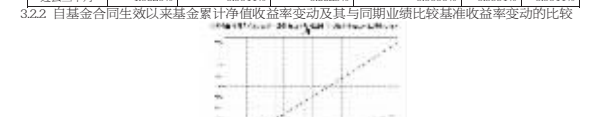
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④
过去三个月	0.0740%	0.0011%	0.0339%	0.0011%

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。至本报告期末,本基金的建仓期间尚未结束。

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 任职日期 离任日期	证券从业年限	说明
康迎	基金经理	2016年11月20日	13年	硕士研究生,2002年7月至2003年1月,任职于交通银行北京分行,担任交易员;2004年1月至2008年11月,任职于华夏银行总行资产管理部,担任交易员;2008年12月至2013年12月,任平安基金基金、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,历任国寿安保货币市场基金、国寿安保鑫鑫货币市场基金、国寿安保鑫鑫货币市场基金及国寿安保鑫鑫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,本着诚实信用、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投资基金限制行为对基金份额持有人的利益。

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