国寿安保增金宝货币市场基金

【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:浙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责任。

基金托管人浙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	国寿安保增金宝货币
交易代码	001826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月23日
报告期末基金份额总额	1,250,831,117.02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	浙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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	7,420,235.48
2. 本期利润	7,420,235.48
3. 期末基金资产净值	1,250,831,117.02

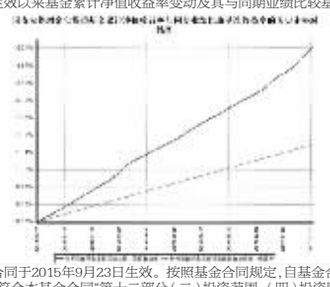
注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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	0.9441%	0.0048%	0.3329%	0.0000%	0.6112%	0.0048%

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9月23日生效。按照基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同"第十二部分(二)投资范围、(四)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9月23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		
黄力	基金经理	2015年9月23日	-	7年	黄力先生,硕士,中国籍。曾任中国人寿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、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。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》、《国寿安保增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

一季度国内经济总体运行平稳,局部出现转暖迹象。价格方面,受去年低基数和"供给侧"改革影响,PPI同比涨幅维持高位;CPI在2月份处于较低水平。在工业品价格带动下,上游企业盈利状况改善。融资需求回升,按揭贷款需求旺盛,同时在基建等拉动下,企业中长期贷款也明显增加,前两个月信贷超预期。国际方面,受通胀和就业数据回暖影响,美联储2月份释放超预期鹰派信号,并在3月份再次加息。流动性层面,2016年底中央经济工作会议提出将防控金融风险放在更加重要的位置,并强调调节货币阀门;3月份商业银行理财首次纳入MPA考核,本季度货币市场流动性总体中性,局部偏紧。债券市场短久期收益率整体呈震荡向上走势,并在3月底流动性紧张状况缓解后震荡向下。

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,在预定到期日内以投资价值较高的同业存款和存单为主,保持了较高的静态收益率,并在春节前和季末等关键时点把握住配置机会,拉长组合剩余期限。杠杆方面,根据流动性状况灵活调整,通过积极交易在保证组合流动性基础上尽量做到收益平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值收益率为0.9441%,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	382,501,595.14	27.38
	其中:债券	382,501,595.14	27.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	225,500,898.25	16.14
	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	760,086,238.75	54.41
4	其他资产	28,906,101.30	2.07
5	合计	1,396,994,833.44	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	7.67
	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	145,249,382.12	11.61
	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	91
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

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	19.63	11.61
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	47.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	22.29	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.37	11.61

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

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	70,106,569.48	5.60
	其中:政策性金融债	70,106,569.48	5.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	312,395,025.66	24.97
8	其他	-	-
9	合计	382,501,595.14	30.58
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	111791846	17广州农村商业银行CD013	500,000	49,724,795.17	3.98
2	111611204	16平安CD204	300,000	30,000,000.00	2.40
3	111708081	17中信银行CD081	300,000	29,705,314.37	2.37
4	111697242	16河北银行CD042	300,000	29,400,085.17	2.35
5	111697361	16成都农商银行CD023	300,000	29,399,403.28	2.35
6	140225	14国开25	200,000	20,142,191.87	1.61
7	111607080	16招行CD080	200,000	20,001,607.09	1.60
8	170301	17进出01	200,000	19,949,635.36	1.59
9	111699742	16威海商行CD046	200,000	19,904,592.07	1.59
10	111792261	17成都银行CD010	200,000	19,873,945.87	1.59

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

序号	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		
报告期内偏离度的最低值		
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 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	4,339,750.84
4	应收申购款	24,566,350.46
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	28,906,101.30

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	440,216,274.03
报告期期间基金总申购份额	2,613,451,013.12
报告期期间基金总赎回份额	1,802,836,170.13
报告期期末基金份额总额	1,250,831,117.02

§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	基金转换入	2017年1月19日	50,000,000.00	50,000,000.00	0.00%
2	基金转换入	2017年2月8日	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
3	基金转换入	2017年3月17日	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
4	基金转换出	2017年1月12日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
5	基金转换出	2017年2月20日	190,000,000.00	190,000,000.00	0.00%
6	红利再投资	2017年3月31日	1,066,138.67	-	0.00%
合计			471,066,138.67	470,000,000.00	

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;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

序号	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	20170101-20170125、20170207-20170210-20170302	155,417,311.80	1,483,282.96	-	156,900,594.76	12.54%
	2	20170101-20170111、20170119-20170125、20170208-20170219	118,781,338.17	251,066,138.67	220,000,000.00	149,847,476.84	11.98%
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增金宝货币市场基金募集的文件

9.1.2《国寿安保增金宝货币市场基金基金合同》

9.1.3《国寿安保增金宝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 报告期内国寿安保增金宝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
2017年4月22日

国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金

【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:中国工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责任。

基金托管人中国工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	国寿安保尊利增强回报债券
交易代码	002720
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月26日
报告期末基金份额总额	143,259,173.67份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过主要投资于债券、银行存款、债券回购等固定收益类金融工具,并适时配置权益资产,以及通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,通过主动管理投资策略,在主要配置债券资产的前提下,适当配置权益类资产,达到增强收益的目的。
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。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低预期风险、较低预期收益的品种。从预期风险收益方面看,本基金的预期风险收益水平相应会高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	国寿安保尊利增强回报债券A	国寿安保尊利增强回报债券C
下属分级基金的交易代码	002720	002721
报告期末下属分级基金的份额总额	132,339,793.33份	10,919,380.34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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	国寿安保尊利增强回报债券A	国寿安保尊利增强回报债券C
1. 本期已实现收益	901,303.41	70,527.91
2. 本期利润	893,904.68	71,123.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0052
4. 期末基金资产净值	133,247,593.02	10,970,829.38
5. 期末基金份额净值	1.007	1.005

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

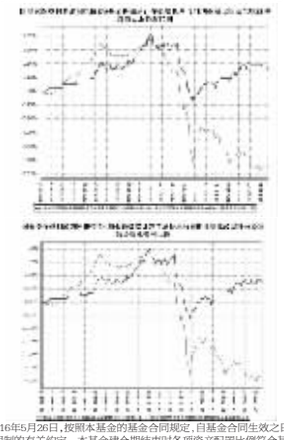
国寿安保尊利增强回报债券A

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	0.60%	0.07%	-1.24%	0.07%	1.84%	0.00%

国寿安保尊利增强回报债券C

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	0.50%	0.07%	-1.24%	0.07%	1.74%	0.00%

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2016年5月26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
		任职日期	离任日期		
董瑞倩	投资管理部总经理、基金经理	2016年5月26日	-	20年	董瑞倩女士,硕士。曾任工银瑞信基金管理有限公司专户投资部基金经理,中银国际证券有限责任公司定息收益部副总经理,执行总经理;现任国寿安保基金管理有限公司投资管理部总经理,国寿安保尊享债券型证券投资基金、国寿安保尊益信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保稳定回报混合型证券投资基金、国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保稳健回报混合型证券投资基金、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、国寿安保稳信混合型证券投资基金及国寿安保尊裕优化回报债券型证券投资基金基金经理。
李一鸣	基金经理	2016年5月26日	-	9年	曾任中银国际定息收益部研究员、中信证券固定收益部研究员,2013年11月加入国寿安保基金任基金经理助理,现任国寿安保尊益信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金、国寿安保安璟纯债债券型证券投资基金、国寿安保安享纯债债券型证券投资基金及国寿安保稳嘉混合型证券投资基金基金经理。
李捷	基金经理	2016年6月29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。

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》、《国寿安保尊利增强回报债券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

2017年一季度中国经济呈现企稳态势,虽然重点城市的房地产限购升级,但三线城市的地产销售仍有余温,房地产投资短期维持高位,基建投资继续保持高速增长,出口部门亦受到外需改善的支撑。物价方面,以猪肉为代表的食品价格走势趋弱,海外原油价格下挫也带动国内商品价格下跌,通胀预期有所降温。政策方面,货币政策基调更加趋于稳健中性,央行两次上调公开市场和MLF利率,季度末资金面受MPA考核波动加大,资金面呈现紧平衡局面。

一季度货币市场利率中枢上行,债券市场收益率整体回升,3月以来在配置需求增强、通胀预期回落的影响下,债市情绪回暖并呈现震荡走势。

投资运作方面,本基金2017年一季度以中短久期、中高评级信用债为主要配置品种,择机参与长期利率债交易和可转债打新。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年3月31日,本基金A类基金份额净值为1.286元,累计份额净值为1.286元,C类基金份额净值为1.279元,累计份额净值为1.279元。报告期内A类基金份额净值增长率为0.60%,C类基金份额净值增长率为0.50%,同期业绩基准涨幅为-1.24%。

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	12,336,994.92	7.01
	其中:股票	12,336,994.92	7.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	157,688,875.80	89.55
	其中:债券	157,688,875.80	89.55
	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	-	-
	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	2,155,224.79	1.22
8	其他资产	3,918,284.81	2.23
9	合计	176,099,380.32	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	8,625,525.00	5.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	292,800.00	0.20
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,336,000.00	0.93
J	金融业	979,469.92	0.68
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,103,200.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,336,994.92	8.55

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	300231	银信科技	80,000	1,336,000.00	0.93
2	002465	海格通信	100,000	1,174,000.00	0.81
3	002400	省广股份	80,000	1,103,200.00	0.76
4	600189	吉林森工	100,000	1,051,000.00	0.73
5	000783	长江证券	100,048	979,469.92	0.68
6	000425	徐工机械	200,000	814,000.00	0.56
7	600273	嘉化能源	90,000	804,600.00	0.56
8	600418	江淮汽车	60,000	703,200.00	0.49
9	300263	隆华节能	90,000	604,800.00	0.42
10	600970	中材国际	45,000	481,500.00	0.33

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	2,998,200.00	2.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,996,000.00	3.46
	其中:政策性金融债	4,996,000.00	3.46
4	企业债券	16,536,790.40	11.47
5	企业短期融资券	90,279,000.00	62.60
6	中期票据	41,044,000.00	28.46
7	可转债(可交换债)	1,834,885.40	1.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	157,688,875.80	109.34

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	101458012	14龙净环保MTN001	100,000	10,676,000.00	7.40
2	101464021	14赣建工MTN001	100,000	10,175,000.00	7.06
3	101565019	15西北部MTN001	100,000	10,117,000.00	7.02
4	041658007	16孚日CP001	100,000	10,098,000.00	7.00
5	011697038	16一心堂SCP001	100,000	10,090,000.00	7.00

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国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,078.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,896,205.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,918,284.81

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	181,615.00	0.13

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002400	省广股份	1,103,200.00	0.76	公告重大事项

5.10.6 报告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	国寿安保尊利增强回报债券A	国寿安保尊利增强回报债券C
报告期期初基金份额总额	173,625,364.77	15,224,658.10
报告期期间基金总申购份额	23,866.90	398.51
减:报告期期间基金总赎回份额	41,309,438.34	4,305,676.27
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	132,339,793.33	10,919,380.34

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内本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	80,001,600.00	-	-	80,001,600.00	55.84%
	2	20170101-20170331	50,003,500.00		19,900,000.00	30,103,500.00	21.01%
	3	20170101-20170109	39,000,800.00		21,000,000.00	18,000,800.00	12.57%
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尊利增强回报债券型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保尊利增强回报债券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 报告期内国寿安保尊利增强回报债券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

国寿安保尊享债券型证券投资基金

【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	国寿安保尊享债券
交易代码	000668
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年7月24日
报告期末基金份额总额	5,165,662,290.82份
投资目标	本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入