国寿安保健康科学混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月19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11月1日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保健康科学混合	
交易代码	005043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月1日	
报告期末基金份额总额	325,312,248.27份	
投资目标	本基金通过把握健康科学产业投资价值,在严格管理投资风险的前提下,追求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,当具备足够多本基金所定义的“健康科学”相关的投资标的时,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*70%+中证全债指数收益率*30%	
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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保健康科学混合A	国寿安保健康科学混合C
下属分级基金的交易代码	005043	005044
报告期末下属分级基金的份额总额	216,113,445.91份	109,198,802.36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11月1日 - 2017年12月31日)	
	国寿安保健康科学混合A	国寿安保健康科学混合C
1. 本期已实现收益	403,721.42	138,156.44
2. 本期利润	819,983.93	370,165.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0037	0.0032
4. 期末基金资产净值	216,894,881.83	109,526,642.50
5. 期末基金份额净值	1.0036	1.0030

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与同期业绩比较基准收益率的比较

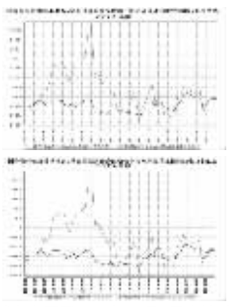
国寿安保健康科学混合A

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	0.36%	0.20%	0.37%	0.63%	-0.01%	-0.43%

国寿安保健康科学混合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	0.30%	0.20%	0.37%	0.63%	-0.07%	-0.43%

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2017年11月1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建仓期尚未结束。

§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		
张琦	基金经理	2017年11月1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、国寿安保目标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金及国寿安保健康科学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》、《国寿安保健康科学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年四季度,A股市场先扬后抑,上证指数一度冲破3450点关口,之后出现较大幅度的下跌。总体来看,年底投资者存在获利了结的倾向,投资者之间的博弈明显加剧,但并没有改变市场整体的运行逻辑。从季度来看,指数出现普涨局面,上证综指上涨4.90%,沪深300指数上涨4.63%,创业板指数上涨2.69%。从行业表现来看,食品饮料、家电、电子行业涨幅居前,综合、建筑、纺织服装等行业跌幅居前。

2. 运行分析

2017年四季度,国寿安保健康科学基金处在建仓期,严格按照基金契约的要求进行相应的建仓。组合权益持仓均为医药行业个股,主要围绕创新药、一致性评价和低估值等方向进行了相应的个股选择。截至2017年12月31日,基金组合中持有的股票市值占资产净值比例为23.85%,持有的债券市值比例为0。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保健康科学混合A基金份额净值为1.0036元,本报告期基金份额净值增长率为0.36%;截至本报告期末国寿安保健康科学混合C基金份额净值为1.0030元,本报告期基金份额净值增长率为0.30%;同期业绩比较基准收益率为0.37%。

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	77,835,957.28	23.44
	其中:股票	77,835,957.28	23.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	215,000,000.00	64.74
	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	39,029,783.69	11.75
8	其他资产	216,602.45	0.07
9	合计	332,082,343.42	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	-	-
C	制造业	68,406,557.28	20.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,430,400.00	2.89
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	77,835,957.28	23.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002294	信立泰	200,000	9,038,000.00	2.77
2	600276	恒瑞医药	117,459	8,102,321.82	2.48
3	000423	东阿阿胶	120,000	7,232,400.00	2.22
4	600529	山东药玻	269,921	5,981,449.36	1.83
5	600285	羚锐制药	599,937	5,579,414.10	1.71
6	600993	马应龙	250,000	5,120,000.00	1.57
7	002422	科伦药业	200,000	4,980,000.00	1.53
8	002737	葵花药业	152,100	4,687,722.00	1.44
9	000963	华东医药	80,000	4,310,400.00	1.32
10	002020	京新药业	340,000	3,906,600.00	1.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	21,321.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	184,670.08
5	应收申购款	10,610.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	216,602.45

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未存在流通受限制的情况。

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	国寿安保健康科学混合A	国寿安保健康科学混合C
基金合同生效日(2017年11月1日)基金份额总额	339,808,358.01	117,033,721.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	113,578.13	32,227.52
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	6,774,768.91	7,867,146.48
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	216,113,445.91	109,198,802.36

§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

无。

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健康科学混合型证券投资基金募集的文件

9.1.2《国寿安保健康科学混合型证券投资基金基金合同》

9.1.3《国寿安保健康科学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 报告期内国寿安保成长优选股票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
2018年1月20日

国寿安保添利货币市场基金

2017年第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2018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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年01月19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	国寿安保添利货币	
交易代码	003422	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月27日	
报告期末基金份额总额	27,478,875,211.81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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保添利货币A	国寿安保添利货币B
下属分级基金的交易代码	003422	003423
报告期末下属分级基金的份额总额	15,145,639.30份	27,463,729,572.51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10月1日 - 2017年12月31日)	
	国寿安保添利货币A	国寿安保添利货币B
1. 本期已实现收益	137,802.53	297,813,019.13
2. 本期利润	137,802.53	297,813,019.13
3. 期末基金资产净值	15,145,639.30	27,463,729,572.51

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

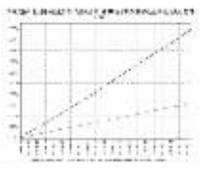
国寿安保添利货币A

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	1.0794%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.7391%	0.0007%

国寿安保添利货币B

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	1.1403%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.8000%	0.0007%

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。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		
桑迎	基金经理	2016年12月27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、国寿安保新金宝货币市场基金、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

4.4.1 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。

4.4.2 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年四季度,国寿安保健康科学基金处在建仓期,严格按照基金契约的要求进行相应的建仓。组合权益持仓均为医药行业个股,主要围绕创新药、一致性评价和低估值等方向进行了相应的个股选择。截至2017年12月31日,基金组合中持有的股票市值占资产净值比例为23.85%,持有的债券市值比例为0。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保健康科学混合A基金份额净值为1.0036元,本报告期基金份额净值增长率为0.36%;截至本报告期末国寿安保健康科学混合C基金份额净值为1.0030元,本报告期基金份额净值增长率为0.30%;同期业绩比较基准收益率为0.37%。

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	77,835,957.28	23.44
	其中:股票	77,835,957.28	23.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	215,000,000.00	64.74
	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	39,029,783.69	11.75
8	其他资产	216,602.45	0.07
9	合计	332,082,343.42	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	-	-
C	制造业	68,406,557.28	20.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,430,400.00	2.89
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	77,835,957.28	23.85

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002294	信立泰	200,000	9,038,000.00	2.77
2	600276	恒瑞医药	117,459	8,102,321.82	2.48
3	000423	东阿阿胶	120,000	7,232,400.00	2.22
4	600529	山东药玻	269,921	5,981,449.36	1.83
5	600285	羚锐制药	599,937	5,579,414.10	1.71
6	600993	马应龙	250,000	5,120,000.00	1.57
7	002422	科伦药业	200,000	4,980,000.00	1.53
8	002737	葵花药业	152,100	4,687,722.00	1.44
9	000963	华东医药	80,000	4,310,400.00	1.32
10	002020	京新药业	340,000	3,906,600.00	1.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	21,321.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	184,670.08
5	应收申购款	10,610.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	216,602.45

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未存在流通受限制的情况。

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	国寿安保添利货币A	国寿安保添利货币B
报告期期初基金份额总额	9,661,588.59	25,107,454,475.35
报告期期间基金总申购份额	12,143,392.42	9,073,563,096.50
报告期期间基金总赎回份额	6,659,341.71	6,717,287,999.34
报告期期末基金份额总额	15,145,639.30	27,463,729,572.51

§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	申购	2017年10月13日	23,000,000.00	23,000,000.00	0.00%
2	红利再投资	2017年10月16日	119,859.09	119,859.09	0.00%
3	红利再投资	2017年10月16日	209,804.47	209,804.47	0.00%
4	赎回	2017年10月25日	5,000,000.00	5,000,000.00	0.00%
5	申购	2017年11月7日	30,000,000.00	30,000,000.00	0.00%
6	红利再投资	2017年11月15日	116,848.57	116,848.57	0.00%
7	红利再投资	2017年11月15日	293,620.36	293,620.36	0.00%
8	赎回	2017年11月21日	4,000,000.00	4,000,000.00	0.00%
9	赎回	2017年11月27日	9,000,000.00	9,000,000.00	0.00%
10	申购	2017年12月7日	28,000,000.00	28,000,000.00	0.00%
11	赎回	2017年12月12日	20,000,000.00	20,000,000.00	0.00%
12	红利再投资	2017年12月15日	120,007.35	120,007.35	0.00%
13	红利再投资	2017年12月15日	365,874.45	365,874.45	0.00%
14	赎回	2017年12月20日	10,001,000.00	10,001,000.00	0.00%
15	赎回	2017年12月25日	7,000,000.00	7,000,000.00	0.00%
16	赎回	2017年12月29日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
合计			138,227,014.29	138,227,014.29	

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。

§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

		报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
		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
	1	20171001-20171226	5,116,496,098.83	56,827,663.87	-		5,173,323,762.70	18.86%
	2	20171001-20171207	5,533,965,305.43	61,276,987.35	2,040,733,598.83		3,554,508,693.95	12.96%
	-	-	-	-	-		-	-
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添利货币市场基金募集的文件

9.1.2《国寿安保添利货币市场基金基金合同》

9.1.3《国寿安保添利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 报告期内国寿安保添利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
2018年1月20日

国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

基金管理人:国寿安保基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月19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	国寿安保稳泰一年定开混合	
交易代码	004772	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8月22日	
报告期末基金份额总额	489,505,550.76份	
投资目标	本基金将通过对宏观经济和资本市场的深入分析,采用主动的投资管理策略,把握不同时期各金融市场的收益水平,根据约定的投资比例配置股票、债券、货币市场工具等各类资产,在严格控制下行风险的前提下,力争为投资人获取基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	封闭期内,本基金的资产配置策略注重将定性资产配置和定量资产配置进行有机的结合,根据经济情景、类别资产收益风险预期等因素,确定不同阶段基金资产中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例,力争获得基金资产的长期稳定增值。 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中等风险/收益的投资品种。	
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	国寿安保稳泰一年定开混合A	国寿安保稳泰一年定开混合C
下属分级基金的交易代码	004772	004773
报告期末下属分级基金的份额总额	117,457,051.27份	372,048,508.49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10月1日 - 2017年12月31日)	
	国寿安保稳泰一年定开混合A	国寿安保稳泰一年定开混合C
1. 本期已实现收益	850,207.24	2,120,804.75
2. 本期利润	959,131.76	2,467,035.28
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0082	0.0066
4. 期末基金资产净值	118,975,799.48	376,048,503.26
5. 期末基金份额净值	1.0129	1.0108

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

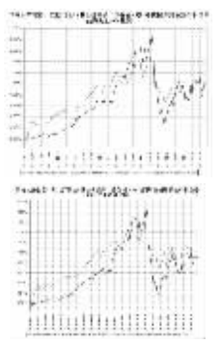
国寿安保稳泰一年定开混合A

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	0.81%	0.21%	0.46%	0.17%	0.35%	0.04%

国寿安保稳泰一年定开混合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	0.67%	0.21%	0.46%	0.17%	0.21%	0.04%

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2017年8月22日,按照本基金的基金合