

国寿安保尊盈一年定期开放  
债券型证券投资基金  
2016 年年度报告（摘要）

2016 年 12 月 31 日

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

送出日期：2017 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国寿安保尊盈一年定期开放债券	
基金主代码	001847	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 3 日	
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	
报告期末基金份额总额	732, 838, 331. 89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码:	001847	001848
报告期末下属分级基金的份额总额	683, 739, 193. 15 份	49, 099, 138. 74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求安全、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	本基金在投资策略上兼顾投资原则以及定期开放基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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，采用期限匹配下的主动性投资策略，主要包括：类属资产配置策略、期限配置策略、回购套利策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等投资管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种固定收益品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率（税后）+1. 2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张彬
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95588
传真	010-50850776	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年		2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	
	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C
本期已实现收益	12,203,341.22	688,236.89	3,003,742.88	191,522.69
本期利润	10,331,521.44	625,670.04	-2,879,894.53	-242,919.85
加权平均基金份额本期利润	0.0159	0.0132	-0.0044	-0.0051
本期基金份额净值增长率	1.61%	1.31%	-0.40%	-0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0125	0.0077	-0.0044	-0.0051
期末基金资产净值	692,263,180.01	49,477,311.82	644,643,259.63	47,574,114.27
期末基金份额净值	1.012	1.008	0.996	0.995

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 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

国寿安保尊盈一年定期开放债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.46%	0.12%	0.66%	0.01%	-2.12%	0.11%
过去六个月	0.90%	0.10%	1.33%	0.01%	-0.43%	0.09%
过去一年	1.61%	0.11%	2.69%	0.01%	-1.08%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.20%	0.11%	3.14%	0.01%	-1.94%	0.10%

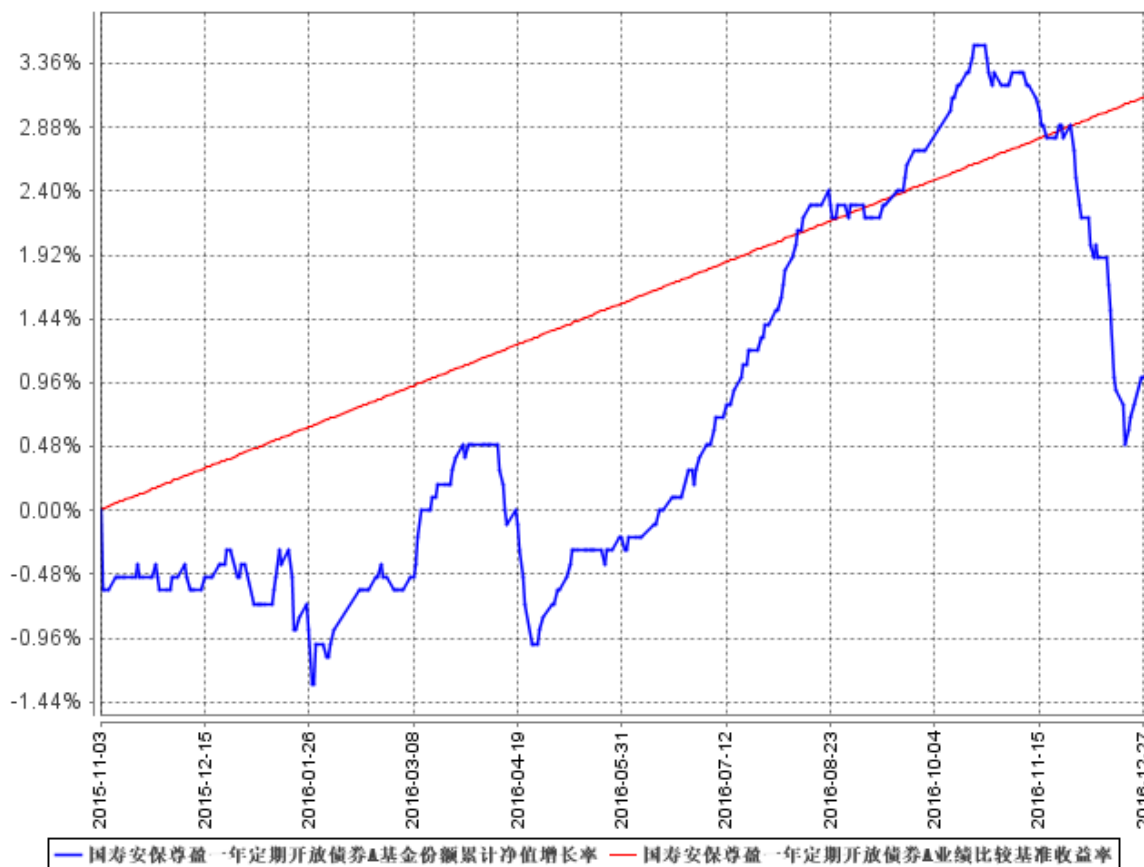
国寿安保尊盈一年定期开放债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.56%	0.12%	0.66%	0.01%	-2.22%	0.11%
过去六个月	0.70%	0.10%	1.33%	0.01%	-0.63%	0.09%
过去一年	1.31%	0.11%	2.69%	0.01%	-1.38%	0.10%
自基金合同	0.80%	0.11%	3.14%	0.01%	-2.34%	0.10%

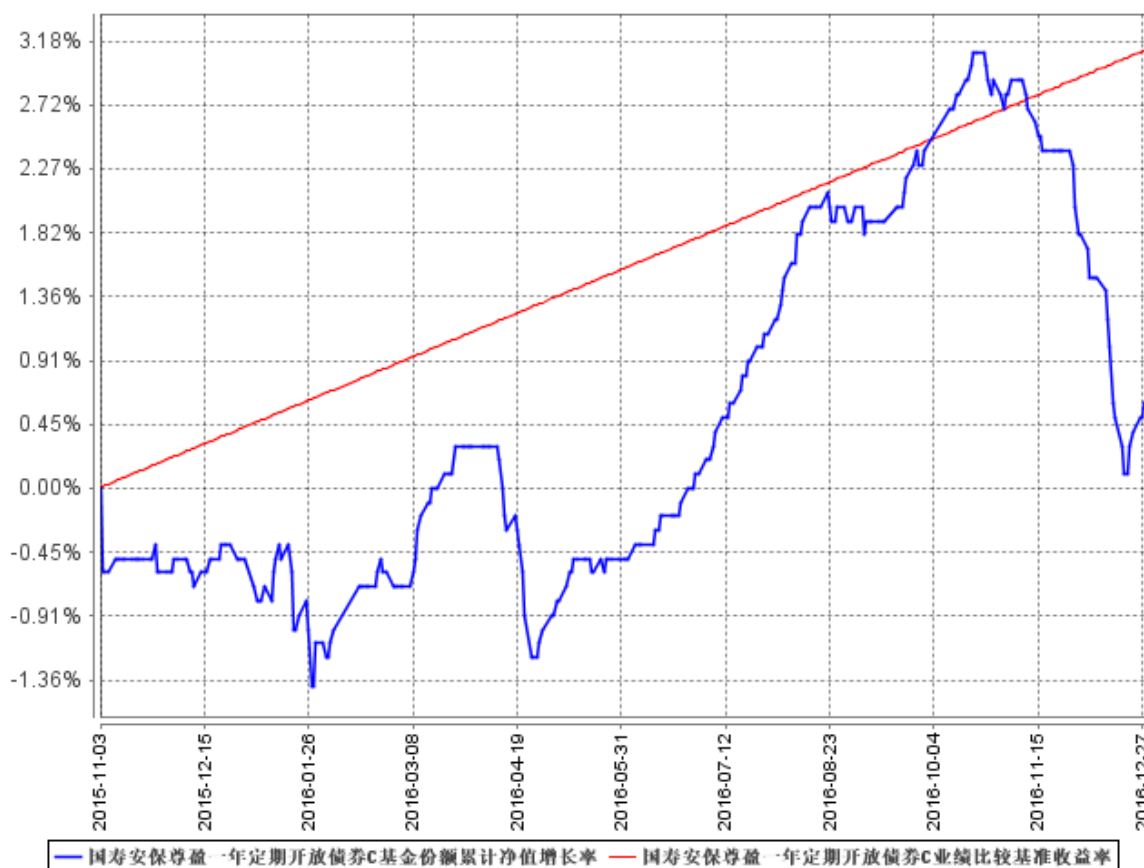
生效起至今					
-------	--	--	--	--	--

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国寿安保尊盈一年定期开放债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



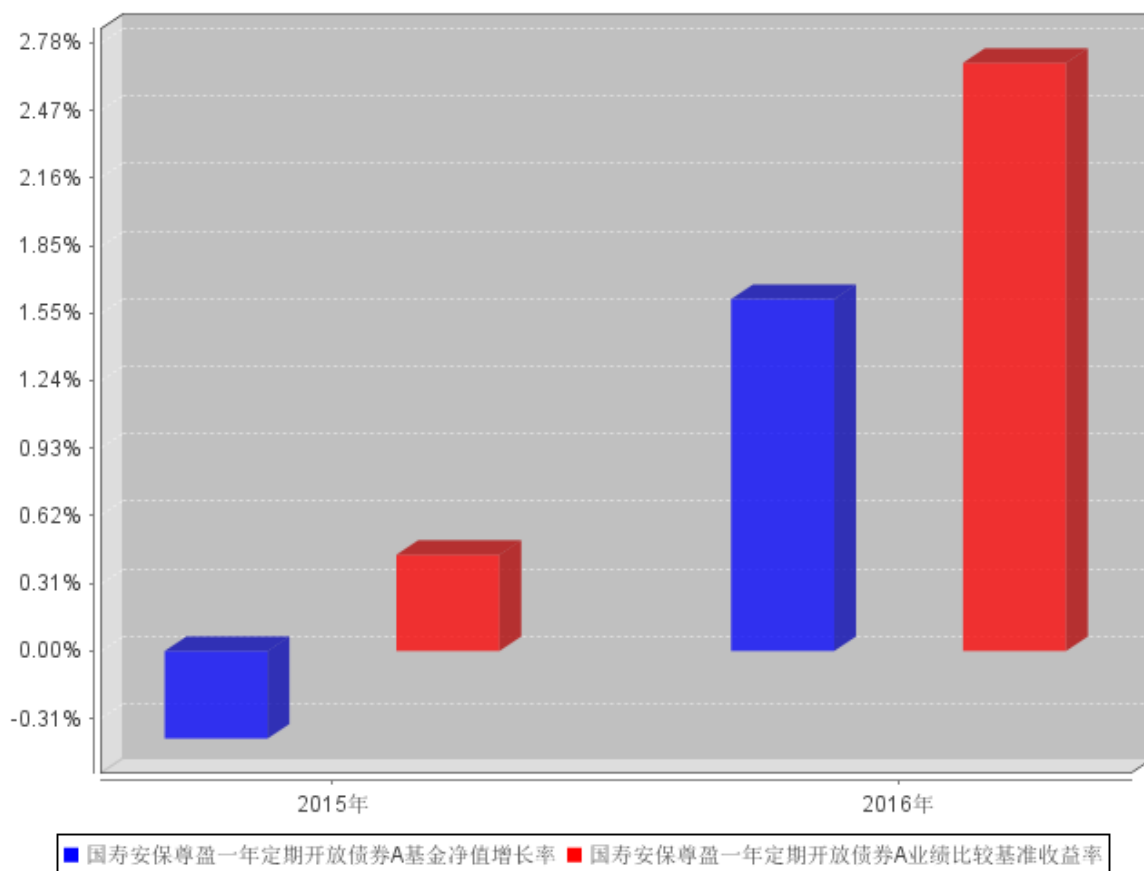
国寿安保尊盈一年定期开放债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



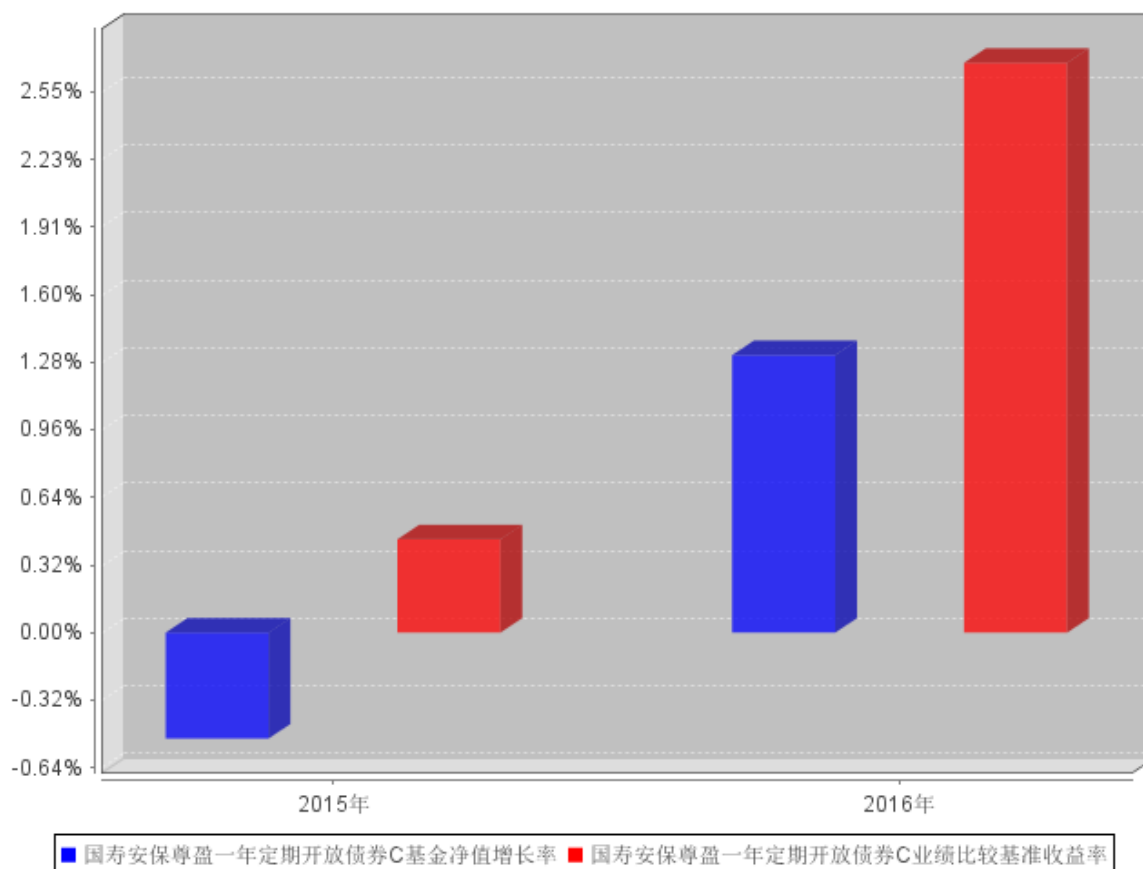
注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 11 月 3 日。按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

### 国寿安保尊盈一年定期开放债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



国寿安保尊盈一年定期开放债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2013]1308号文核准,于2013年10月29日设立,公司注册资本5.88亿元人民币,公司股东为中国人寿资产管理有限公司,持有股份85.03%,AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED(澳大利亚安保资本投资有限公司),持有股份14.97%。

截至2016年12月31日,公司共管理25只开放式基金和部分特定资产管理计划,公司管理资产总规模为1151.37亿元,其中公募基金管理规模785.16亿元。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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	2015 年 11 月 3 日	-	19 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及国寿安保尊利增强回报债券型证券投资基金基金经理。
方旭赞	基金经理	2016 年 7 月 5 日	-	5 年	方旭赞先生，北京大学数学学士，金融学硕士，注册金融分析师（CFA）。曾任南方基金固定收益部研究员，2014 年 10 月加入国寿安保基金任基金经理助理，现任国寿安保尊盈一年定期开放债券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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执

行，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。

### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年中国债券市场波动剧烈，机构配置行为和流动性因素对市场的影响力日益加深，而经济基本面对利率的驱动则显得较为迟缓。前三季度在银行委外、同业理财等配置力量的推动下，债券行情呈现出资金推动的特征，债券利率持续回落逼近 2008 年的历史低点，信用利差逐渐压缩至历史低位，期间仅在 4 月份因机构集中赎回出现短期回调。四季度开始，工业品价格上涨和海外再通胀预期对债市形成利空，同时监管部门对降杠杆、防风险的态度更加明朗，金融机构融资成本抬升，债券市场出现机构赎回、下跌、进一步赎回的负循环，债券收益率大幅上行。

投资运作方面，本基金在报告期内以中高等级的公司债和短融为主要配置品种，并积极参与利率债的波段交易，在四季度减持组合的长期利率债和部分流动性较好的信用债，同时降低了组合的可转债仓位。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.012 元，累计份额净值为 1.012 元，C 类基金份额净值为 1.008 元，累计份额净值为 1.008 元。报告期内 A 类基金份额净值增长率为 1.61%，C 类基金份额净值增长率为 1.31%，同期业绩基准涨幅为 2.69%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年中国经济的内生增长动力并不强劲，全年来看经济基本面对债券市场仍有一定支撑。从长周期来看，劳动力、资源等要素成本的抬升使得中国经济潜在增长率逐渐回落，经济增长越来越受到人口老龄化及资源环境的制约。中期而言，产能过剩和与之相伴的企业部门的高杠杆问题尚未根本改善。短期内，虽然中国经济在前期基建拉动和出口回暖的支撑下表现平稳，但房地产市场在严厉的调控政策下存在放缓的

风险，工业生产端也将逐渐感受到需求走弱的压力，通胀风险预计总体可控。

政策面来看，中央经济工作会议强调货币政策要保持稳健中性，既要维护流动性基本稳定、确保不发生系统性金融风险，又要着力防控资产泡沫。预计央行将继续使用逆回购、SLF、MLF 等工具进行调控并传递价格信号，准备金率调整的概率较小。

市场策略方面，长期来看经济基本面仍然对债市有支撑，在市场调整风险释放后，2017 年债券市场存在一定的交易性机会，有理由对债市保持谨慎乐观态度。本基金未来将采取更加灵活的投资策略，在 2017 年前期优化组合资产配置，减持部分流动性较差的债券，提高组合的流动性，并且密切关注防守反击的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由公司领导担任，委员由运营管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服

务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场交易和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——国寿安保基金管理有限公司在国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国寿安保基金管理有限公司编制和披露的国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明(2017)审字第 61090605_A04 号
--------	------------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金的财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表和 2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人国寿安保基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表, 并使其实现公允反映;(2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为, 上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制, 公允反映了国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	辜虹	范新紫
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼	
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	3, 516, 268. 35	1, 872, 025. 80

结算备付金	11,592,046.56	13,102,090.76
存出保证金	24,809.47	58,537.37
交易性金融资产	859,887,883.26	1,247,683,152.30
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	859,887,883.26	1,237,672,152.30
资产支持证券投资	-	10,011,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	1,000,000.00
应收证券清算款	-	90,017,430.15
应收利息	14,737,911.01	19,227,506.52
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	889,758,918.65	1,372,960,742.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年12月31日</b>	<b>2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	145,000,000.00	680,019,269.97
应付证券清算款	2,120,141.57	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	440,621.05	411,416.28
应付托管费	125,891.73	117,547.52
应付销售服务费	16,797.79	16,160.04
应付交易费用	15,752.09	7,706.14
应交税费	-	-
应付利息	3,222.59	139,269.05
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	296,000.00	32,000.00
负债合计	148,018,426.82	680,743,369.00
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	732,838,331.89	695,340,188.28
未分配利润	8,902,159.94	-3,122,814.38
所有者权益合计	741,740,491.83	692,217,373.90
负债和所有者权益总计	889,758,918.65	1,372,960,742.90

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，国寿安保尊盈一年定期开放债券 A 类基金份额净值人民币 1.012 元，国寿安保尊盈一年定期开放债券 C 类基金份额净值人民币 1.008 元，基金份额总额

732,838,331.89 份, 其中国寿安保尊盈一年定期开放债券 A 类基金份额总额 683,739,193.15 份, 国寿安保尊盈一年定期开放债券 C 类基金份额总额 49,099,138.74 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	28,764,080.89	-1,275,006.61
1.利息收入	46,745,531.01	5,215,722.77
其中: 存款利息收入	344,299.48	64,056.33
债券利息收入	46,293,190.95	4,959,434.02
资产支持证券利息收入	89,432.87	6,575.34
买入返售金融资产收入	18,607.71	185,657.08
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-16,047,239.43	-181,202.12
其中: 股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-16,047,239.43	-181,202.12
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,934,386.63	-6,318,079.95
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	175.94	8,552.69
<b>减: 二、费用</b>	17,806,889.41	1,847,807.77
1. 管理人报酬	4,928,749.26	769,718.94
2. 托管费	1,408,214.11	219,919.70
3. 销售服务费	191,330.15	30,238.01
4. 交易费用	21,363.77	5,451.73
5. 利息支出	10,820,431.82	771,057.16
其中: 卖出回购金融资产支出	10,820,431.82	771,057.16
6. 其他费用	436,800.30	51,422.23
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	10,957,191.48	-3,122,814.38

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	10,957,191.48	-3,122,814.38

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	695,340,188.28	-3,122,814.38	692,217,373.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	10,957,191.48	10,957,191.48
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	37,498,143.61	1,067,782.84	38,565,926.45
其中：1. 基金申购款	254,145,469.64	7,768,540.66	261,914,010.30
2. 基金赎回款	-216,647,326.03	-6,700,757.82	-223,348,083.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	732,838,331.89	8,902,159.94	741,740,491.83
项目	上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	695,340,188.28	-	695,340,188.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-3,122,814.38	-3,122,814.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-



（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	695,340,188.28	-3,122,814.38	692,217,373.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 左季庆	_____ 左季庆	_____ 韩占锋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2014]1344 号文《关于准予国寿安保尊盈一年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2015 年 10 月 12 日至 2015 年 10 月 30 日向社会公开募集，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 11 月 3 日正式生效。本基金为契约型、定期开放式，存续期限不定。本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费，不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；收取销售服务费，不收取认（申）购费的，称为 C 类基金份额。首次募集规模为 647,523,154.16 份 A 类基金份额，47,817,034.12 份 C 类基金份额。国寿安保尊盈一年定期开放债券 A 类及 C 类收到的实收基金合计人民币 695,340,188.28 元，分别折合成 A 类和 C 类基金份额，合计折合 695,340,188.28 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（简称“工商银行”）。

本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资人可自行选择认/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。基金管理人可在符合法律法规和监管规定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，调

整基金份额类别的设置、费率水平及其他具体规则，且无需召开基金份额持有人大会，但基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国家债券、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、证券公司短期公司债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款），以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不直接参与股票投资，但可持有因可转换债券转股所形成的股票（包括因持有该股票所派发的权证）以及因投资可分离债券而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金将在其可交易之日起 30 个交易日内卖出。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。在每个开放期的前 1 个月和后 1 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期内现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯上年度报告期间为 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### **(1) 金融资产分类**

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

###### **(2) 金融负债分类**

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

##### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为

投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转

债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只

有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分

配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日期间均无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日期间均无会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日期间均无会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日期间均无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **7.4.6 税项**

##### **7.4.6.1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税



收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放

式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自 2008 年 10 月 9 日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2013 年 1 月 1 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2015 年 9 月 8 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	3, 516, 268. 35	1, 872, 025. 80
定期存款	-	-

其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,516,268.35	1,872,025.80

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	238,380,068.99	233,333,683.26
	银行间市场	629,760,280.85	626,554,200.00
	合计	868,140,349.84	859,887,883.26
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	868,140,349.84	859,887,883.26	-8,252,466.58
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	741,502,372.74	734,423,152.30
	银行间市场	502,498,859.51	503,249,000.00
	合计	1,244,001,232.25	1,237,672,152.30
资产支持证券	10,000,000.00	10,011,000.00	11,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,254,001,232.25	1,247,683,152.30	-6,318,079.95

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-

项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	1,000,000.00	-
合计	1,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	504.54	6,469.92
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5,738.04	6,485.49
应收债券利息	14,731,656.11	19,207,946.84
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	12.32	6,604.27
合计	14,737,911.01	19,227,506.52

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	15,752.09	7,706.14
合计	15,752.09	7,706.14

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

预提费用	296,000.00	32,000.00
合计	296,000.00	32,000.00

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保尊盈一年定期开放债券 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	647,523,154.16	647,523,154.16
本期申购	216,342,502.77	216,342,502.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-180,126,463.78	-180,126,463.78
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	683,739,193.15	683,739,193.15
国寿安保尊盈一年定期开放债券 C		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	47,817,034.12	47,817,034.12
本期申购	37,802,966.87	37,802,966.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-36,520,862.25	-36,520,862.25
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	49,099,138.74	49,099,138.74

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保尊盈一年定期开放债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,003,742.88	-5,883,637.41	-2,879,894.53
本期利润	12,203,341.22	-1,871,819.78	10,331,521.44
本期基金份额交易产生的变动数	1,000,105.66	72,254.29	1,072,359.95
其中：基金申购款	4,772,329.60	1,980,007.93	6,752,337.53
基金赎回款	-3,772,223.94	-1,907,753.64	-5,679,977.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,207,189.76	-7,683,202.90	8,523,986.86
国寿安保尊盈一年定期开放债券 C			

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	191,522.69	-434,442.54	-242,919.85
本期利润	688,236.89	-62,566.85	625,670.04
本期基金份额交易产生的变动数	48,104.97	-52,682.08	-4,577.11
其中:基金申购款	652,915.52	363,287.61	1,016,203.13
基金赎回款	-604,810.55	-415,969.69	-1,020,780.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	927,864.55	-549,691.47	378,173.08

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
活期存款利息收入	71,865.18	46,289.57
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	271,652.45	17,687.78
其他	781.85	78.98
合计	344,299.48	64,056.33

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均无买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-16,047,239.43	-181,202.12
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-16,047,239.43	-181,202.12

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	1,942,656,974.94	9,149,038.21
减:卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	1,919,990,580.33	9,321,902.15
减:应收利息总额	38,713,634.04	8,338.18
买卖债券差价收入	-16,047,239.43	-181,202.12

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合 同生效日)至2015年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	10,076,806.58	-
减:卖出资产支持证券成本总额	10,000,000.00	-
减:应收利息总额	76,806.58	-
资产支持证券投资收益	-	-

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均无贵金属投资产生的收益/损失。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均无衍生工具产生的收益/损失。

**7.4.7.16 股利收益**

本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日期间均无股利收益。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,934,386.63	-6,318,079.95
——股票投资	-	-

——债券投资	-1,923,386.63	-6,329,079.95
——资产支持证券投资	-11,000.00	11,000.00
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-1,934,386.63	-6,318,079.95

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	175.94	-
其他	-	8,552.69
合计	175.94	8,552.69

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	3,988.77	1,751.73
银行间市场交易费用	17,375.00	3,700.00
合计	21,363.77	5,451.73

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年11月3日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	-
信息披露费	300,000.00	48,000.00
中债登账户维护费	17,500.00	-
银行费用	24,900.30	3,022.23
上清所账户维护费	13,500.00	-
其他	900.00	400.00
合计	436,800.30	51,422.23

#### 7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司(简称“国寿安保”)	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司(简称“工商银行”)	基金托管人、销售机构



中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.9.2 关联方报酬

#### 7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生 效日）至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,928,749.26	769,718.94
其中：支付销售机构的客户维护费	756,131.39	112,020.26

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.70% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生 效日）至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,408,214.11	219,919.70

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	合计
工商银行	-	177,021.38	177,021.38
国寿安保	-	224.31	224.31
合计	-	177,245.69	177,245.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	合计
工商银行	-	28,732.68	28,732.68
国寿安保	-	39.53	39.53
合计	-	28,772.21	28,772.21

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

销售服务费每日计提，按月支付。销售服务费按前一日的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

### 7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

单位：份

国寿安保尊盈一年定期开放债券 A		
关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
集团公司	240,010,800.00	35.10%	240,010,800.00	37.07%

#### 7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 11 月 3 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	3,516,268.35	71,865.18	1,872,025.80	46,289.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.10 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末及上年度末均未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 145,000,000.00 元，于 2017 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	859,887,883.26	96.64
	其中：债券	859,887,883.26	96.64
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,108,314.91	1.70
7	其他各项资产	14,762,720.48	1.66
8	合计	889,758,918.65	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末未买入股票。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,491,000.00	3.84
	其中：政策性金融债	28,491,000.00	3.84
4	企业债券	341,491,309.30	46.04
5	企业短期融资券	299,645,000.00	40.40
6	中期票据	188,645,000.00	25.43
7	可转债（可交换债）	1,615,573.96	0.22
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	859,887,883.26	115.93

### 8.6 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

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101663005	16 云南农垦 MTN001	400,000	39,932,000.00	5.38
2	122236	12 哈电 01	311,720	31,505,540.40	4.25
3	1580318	15 响水债	310,000	30,851,200.00	4.16
4	011697036	16 兖州煤业 SCP009	300,000	30,042,000.00	4.05
5	101682008	16 鞍钢股 MTN002	300,000	29,985,000.00	4.04

### 8.7 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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,809.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,737,911.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	14,762,720.48
---	----	---------------

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110035	白云转债	249,120.00	0.03
2	110033	国贸转债	229,200.00	0.03
3	113010	江南转债	178,980.00	0.02
4	127003	海印转债	152,717.16	0.02

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	2,153	317,575.10	438,037,710.00	64.07%	245,701,483.15	35.93%
国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	558	87,991.29	0.00	0.00%	49,099,138.74	100.00%
合计	2,711	405,566.39	438,037,710.00	59.77%	294,800,621.89	40.23%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	130,201.16	0.02%
	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	3,944.12	0.01%
	合计	134,145.28	0.02%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	10-50
	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	0-10
	合计	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	0-10
	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C	0-10
	合计	0-10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保尊盈一年定期开放债券 A	国寿安保尊盈一年定期开放债券 C
基金合同生效日(2015 年 11 月 3 日) 基金份额总额	647,523,154.16	47,817,034.12
本报告期初基金份额总额	647,523,154.16	47,817,034.12
本报告期基金总申购份额	216,342,502.77	37,802,966.87
减:本报告期基金总赎回份额	180,126,463.78	36,520,862.25
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	683,739,193.15	49,099,138.74

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本报告期内, 本基金管理人于 2016 年 12 月 30 日发布公告, 王军辉先生自 2016 年 12 月 28 日起任国寿安保基金管理有限公司董事长, 相关任职资格已经中国证监会核准, 刘慧敏先生因工作调动不再担任。

(2) 本报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；



(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	646,497,646.23	100.00%	37,201,300,000.00	100.00%	-	-

国寿安保基金管理有限公司  
2017年3月28日