东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:２０１４年７月１７日

§１ 重要提示

上海东方证券资产管理有限公司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 2014 年7月15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。

上海东方证券资产管理有限公司承诺以诚实信用、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 2014 年4月1日起至6月30 日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	东方红新动力混合
交易代码	000480
前端交易代码	000480
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月28日
报告期末基金份额总额	991,400,913.47份
投资目标	把握中国经济转型期的一些大趋势,深入挖掘隐藏在大趋势下的投资机会,严控风险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以经济发展中的大趋势为投资主线,力求挖掘孕育在大趋势下的投资机会,实现基金资产的长期稳定增值。 管理人通过定性和半定量的比较大类资产之间的风险收益比,在符合基金合同的情况下,在大类资产之间做一个相对最优的配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率＊70%+中国债券总指数收益率＊30%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人	中国工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（2014年4月1日 – 2014年6月30日 ）
1.本期已实现收益	–1.458.301.04
2.本期利润	25.255.190.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0234
4.期末基金资产净值	990,345,081.21
5.期末基金份额净值	0.999

注:❶所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
❷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。

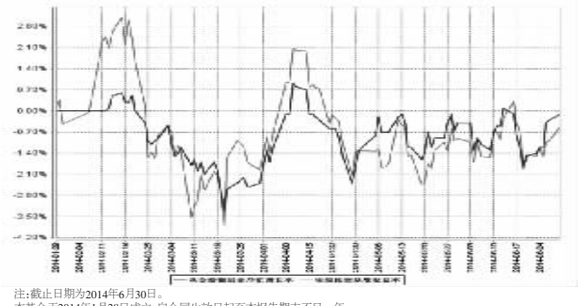
3.2 基金净值表现

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	2.36%	0.48%	1.44%	0.61%	0.92%	–0.13%

注:过去三个月指2014年4月1日–2014年6月30日

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:截止日期为2014年6月30日。

本基金于2014年1月28日成立,自合同生效日起至本报告期末不足一年。

本基金建仓期6个月,即从2014年1月28日起至2014年7月27日,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

§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		
杨达治	本基金基金经理兼任研究部总监、东方红产业升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2014年1月28日	–	12年	硕士,曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部研究员;东方基金有限责任公司研究部研究员;东方证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理;上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、研究部副总监兼投资经理;现任公司执行董事、研究部总监兼东方红新动力、东方红产业升级基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,上海东方证券资产管理有限公司作为东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,制定并严格遵守相应的制度和流程,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内,本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《上海东方证券资产管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金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5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年2季度,股指先抑后扬,尤其是在证监会宣布IPO发行节奏及总量控制后,以创业板为代表的中小市值股票迎来了一波强力反弹。整个2季度,申万A股指数上涨2.7%,创业板综合指数上涨11.27%。本产品较好贯彻了1季报的策略,4、5两个月股票配置比例一直在40%左右,6月提升到50%左右,本季取得2.36%上涨。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金净值增长率为2.36%,业绩比较基准收益率为1.44%。

§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	518,280.423.09	46.18
	其中:股票	518,280.423.09	46.18
2	固定收益投资	262,536,055.82	23.39
	其中:债券	262,536,055.82	23.39
	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	120,000,000.00	10.69
	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	219,908,106.52	19.60
7	其他资产	1,470,567.77	0.13
8	合计	1,122,195,153.20	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	30,625,726.08	3.09
B	采矿业	–	–
C	制造业	377,489,197.82	38.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,960,205.26	6.96
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	1,290,000.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	32,300,293.93	3.26
H	住宿和餐饮业	7,615,000.00	0.77
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	518,280.423.09	52.33

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	000423	东阿阿胶	2,000.000	66,640.000.00	6.73
2	000848	承德露露	2,600.058	51,663,152.46	5.22
3	600886	国投电力	10,000,000	51,000,000.00	5.15
4	600066	宇通客车	3,000,047	48,420,758.58	4.89
5	002008	大族激光	2,500.047	43,350.814.98	4.38
6	600887	伊利股份	1,000.080	33,122,649.60	3.34
7	600050	中国联通	10,000.091	32,300,293.93	3.26
8	002041	登海种业	1,100,062	30,625,726.08	3.09
9	002415	海康威视	1,400,093	23,717,575.42	2.39
10	600690	青岛海尔	1,500.078	22,141,151.28	2.24

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	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	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	262,536.055.82	26.51
8	其他	–	–
9	合计	262,536,055.82	26.51

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	113005	平安转债	750.000	80,115.000.00	8.09
2	110023	民生转债	700.040	64,963.712.00	6.56
3	113001	中行转债	600.000	61,074.000.00	6.17
4	127002	徐工转债	600,059	56,383,343.82	5.69

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注: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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量,以萃取相应股票组合的超额收益。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	696.077.12
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	753.875.88
5	应收申购款	20.614.77
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,470.567.77

5.11.4 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	113005	平安转债	80,115.000.00	8.09
2	110023	民生转债	64,963,712.00	6.56
3	113001	中行转债	61,074.000.00	6.17
4	127002	徐工转债	56,383,343.82	5.69

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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,投资组合报告中市值占净值比例的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	1,145.371.169.07
报告期期间基金总申购份额	3,223,278.51
减:报告期期间基金总赎回份额	157,193,534.11
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	991,400.913.47

§７ 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§８ 影响投资者决策的其他重要信息

本期未发生影响投资者决策的重要信息。

§９ 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金的文件;
2、《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注;
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。

亦可通过公司网站查阅,公司网址为:www.dfham.com。

上海东方证券资产管理有限公司
2014年7月17日

国寿安保货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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
报告送出日期:2014年7月17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的基金合同规定,于2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	国寿安保货币	
基金主代码	000505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年01月20日	
报告期末基金份额总额	17,172.688.252.83份	
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。	
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率低于股票型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国寿安保货币A	国寿安保货币B
下属两级基金的交易代码	000505	000506
报告期末下属两级基金的份额总额	533,618.246.04	16,639.070.006.79

§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（2014年04月01日–2014年06月30日）	
	国寿安保货币A	国寿安保货币B
1.本期已实现收益	8,194.883.97	215.000.427.88
2.本期利润	8,194.883.97	215,000.427.88
3.期末基金资产净值	533,618.246.04	16,639.070.006.79

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

1.国寿安保货币A

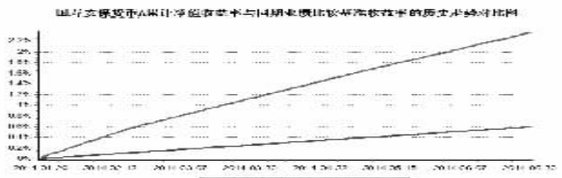
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2022%	0.0023%	0.3366%	0.0000%	0.8656%	0.0023%

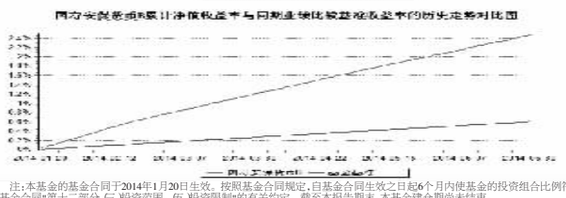
2.国寿安保货币B

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	1.2628%	0.0023%	0.3366%	0.0000%	0.9262%	0.0023%

注:本基金每日进行收益分配,并按月结转为基金份额。

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1月20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、（五）投资限制"的有关约定。截至本报告期末,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		
黄力	国寿安保货币市场基金基金经理	2014年01月20日	–	4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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

上半年,宏观经济下行压力偏大,定向微刺激政策频繁出台,政策重心倾向稳增长。央行也一改去年"钱荒"时流动性管理态度,更加积极主动地设定货币市场短期利率走廊,创造较为宽松的货币环境,加上同业非标监管的整顿与强化,债券市场收益率大幅下行。在此背景下,本基金运作及时根据利率走势及宏观研判,调整投资策略,组合久期由短及长,较好把握住了上半年债券牛市的行情;在保持一定比例与开放期期限匹配的基础上,对信用债,采取"一级申购、二级获利减持"滚动交易及"买长卖短"的骑乘交易策略;对中长期政策性金融债积极进行波段交易,博取价差;保持较高比例的杠杆息差策略,增强收益。在5月下旬第一个开放期来临之际,提前减持短期债券回笼流动性,从容满足第一个开放期的流动性需求。

本基金二季度投资中,特别注重流动性风险的控制,确保客户赎回需求。具体品种的投资选择中,我们在预定到期日内选择相对价值较高的品种,平衡流动性与收益性的要求。利用整体资金利率较低的环境,主动增加杠杆率,获取利差收益。通过积极交易在保证申赎资金流动性的基础上尽量做到收益平稳。账户久期相对适中。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值收益率为1.2022%,B类基金份额净值收益率为1.2628%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,宏观经济增速将在政策微刺激的作用下环比达到年内最高增速,维持近几年"年内周期"的趋势。通胀水平将会保持平稳,物价因素暂时不是市场所关注的焦点。货币政策稳中偏松,资金利率大幅上行的可能性较低。同业存款供需格局的转变,银行存款利率偏低。IPO重启后,交易所市场资金波动幅度增大,且在商业银行重获交易所回购资格后,交易所、银行间的资金利率联动性将更强。整体而言,预计三季度资金面相对宽松,但不确定性因素较二季度增加。

投资中,我们将以保持账户流动性为第一要务,严格控制投资品到期期限,应对季节性规模波动。同时,我们密切关注债券交易性机会,跟踪同业业务政策变动,积极应对其对货币基金行业可能的影响。我们将继续选择适中的久期,适度利用杠杆增强收益。我们的目标是在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资回报。

§５ 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	7,573,221.704.69	37.01
	其中:债券	7,373,221,704.69	36.03
	资产支持证券	200,000.000.00	0.98
2	买入返售金融资产	68,992.423.49	0.34
	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	12,505,530,411.15	61.11
4	其他资产	315,913,679.26	1.54
5	合计	20,463,658.218.59	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	12.56
	其中:买断式回购融资	–

序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	3,279.993.740.00	19.10
	其中:买断式回购融资	–	–

注: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个交易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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	87

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180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	25.12	19.10
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.63	–
2	30天（含）—60天	25.34	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.47	–
3	60天（含）—90天	39.44	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.58	–
4	90天（含）—180天	14.79	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天（含）—397天（含）	12.93	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	117.62	19.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	3,220,240,469.06	18.75
	其中:政策性金融债	3,220,240,469.06	18.75
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	4,152,981,235.63	24.18
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	7,373,221,704.69	42.94
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	459,692,120.78	2.68

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

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	090306	09进出06	5,500.000	551,028.756.06	3.21
2	110418	11农发18	5,500,000	549,003,594.77	3.20
3	130322	13进出22	5,000,000	500,646,097.66	2.92
4	110413	11农发13	4,000.000	400,066,936.90	2.33
5	011437005	14中建材SCP005	3,000,000	299,777,868.17	1.75
6	071403006	14中信CP006	2,000,000	199,960,401.58	1.16
7	071402005	14国泰君安CP005	1,900.000	189,978,308.49	1.11
8	071428003	14方正证券CP003	1,800.000	179,977,949.43	1.05
9	041459026	14杉杉CP001	1,600,000	160,000,122.01	0.93
10	011479002	14浙交投SCP002	1,500,000	150,000,091.53	0.87

5.6 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0705%
报告期内偏离度的最低值	0.0311%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0487%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1489050	14甬银1A1	2,000.000	201,460.000.00	1.17

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

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。

5.8.2 本基金在报告期内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮息债的摊余成本超过基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 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	–
2	应收证券清算款	50,555.777.40
3	应收利息	262,319.801.86
4	应收申购款	3,038.100.00
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	315,913,679.26

5.8.5 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

	国寿安保货币A	国寿安保货币B
基金合同生效日基金份额总额	977,743,774.95	10,892,713,655.59
本报告期期初基金份额总额	506,737,800.73	11,692,067,911.49
本报告期基金总申购份额	1,161,357,798.56	28,937,200,478.26
减:本报告期基金总赎回份额	1,134,477,353.25	23,990,198,382.96
本报告期期末基金份额总额	533,618,246.04	16,639,070,006.79

注:报告期内基金总申购份额含红利再投资和基金份额升降级调增份额,基金总赎回份额含升降级调减份额。

§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	收益结转份额	2014年04月15日	85,830.81		–
2	赎回	2014年04月18日	400,000.00	400,000.00	–
3	赎回	2014年04月28日	1,500,000.00	1,500,000.00	–
4	申购	2014年04月29日	680,000.00	680,000.00	–
5	申购	2014年05月07日	1,840,000.00	1,840,000.00	–
6	收益结转份额	2014年05月15日	78,720.13		–
7	赎回	2014年05月19日	2,700,000.00	2,700,000.00	–
8	赎回	2014年05月26日	2,400,000.00	2,400,000.00	–
9	申购	2014年06月06日	1,800,000.00	1,800,000.00	–
10	申购	2014年06月08日	460,000.00	460,000.00	–
11	申购	2014年06月11日	238,000.000.00	238,000.000.00	–
12	收益结转份额	2014年06月16日	193,034.51		–
13	申购	2014年06月23日	246,000,000.00	246,000,000.00	–
14	赎回	2014年06月25日	300,000,000.00	300,000,000.00	–
15	申购	2014年06月26日	126,000,000.00	126,000,000.00	–
合计			922,137,585.45	921,780,000.00	

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。

§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货币市场基金募集的文件

8.1.2 《国寿安保货币市场基金基金合同》

8.1.3 《国寿安保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17号中国人寿中心17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 按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
二〇一四年七月十七日

国开泰富岁月鎏金定期开放信用债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30日

基金管理人:国开泰富基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:２０１４年７月１７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2014年7月16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2014年4月1日起至6月30日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	国开岁月鎏金定开信用债	
交易代码	000412	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月23日	
报告期末基金份额总额	355,685,981.23份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的稳定增值。	
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略,在严格控制风险的前提下,实现风险和收益的最佳配比。 本基金的主要投资策略包括:大类资产配置策略、久期配置策略、期限结构配置策略、类属配置策略、信用类债券策略、息差策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债的投资策略、新股投资策略。	
业绩比较基准	6个月定期存款利率（税后）。 本基金的业绩比较基准将在每一封闭期的第一个工作日,根据中国人民银行公布的金融机构人民币利率进行最新调整。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。	
基金管理人	国开泰富基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国开岁月鎏金定开信用债A	国开岁月鎏金定开信用债C
下属两级基金的交易代码	000412	000413
下属两级基金的前端交易代码	–	–
下属两级基金的后端交易代码	–	–
报告期末下属两级基金的份额总额	327,282,204.86份	28,403,776.37份
下属两级基金的风险收益特征	–	–

§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（2014年4月1日 – 2014年6月30日）	
	国开