国寿安保添利货币市场基金
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 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 2023 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保添利货币	
基金主代码	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	4,126,377,712.14 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	536,560,633.33 份	3,589,817,078.81 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 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	705,246.13	35,716,212.21
2.本期利润	705,246.13	35,716,212.21
3.期末基金资产净值	536,560,633.33	3,589,817,078.81

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 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	0.4490%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.1161%	0.0004%
过去六个月	0.8110%	0.0016%	0.6732%	0.0000%	0.1378%	0.0016%
过去一年	1.4861%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	0.1361%	0.0016%
过去三年	5.3860%	0.0015%	4.0472%	0.0000%	1.3388%	0.0015%
过去五年	11.1986%	0.0037%	6.7500%	0.0000%	4.4486%	0.0037%
自基金合同生效起至今	17.1824%	0.0041%	8.4513%	0.0000%	8.7311%	0.0041%

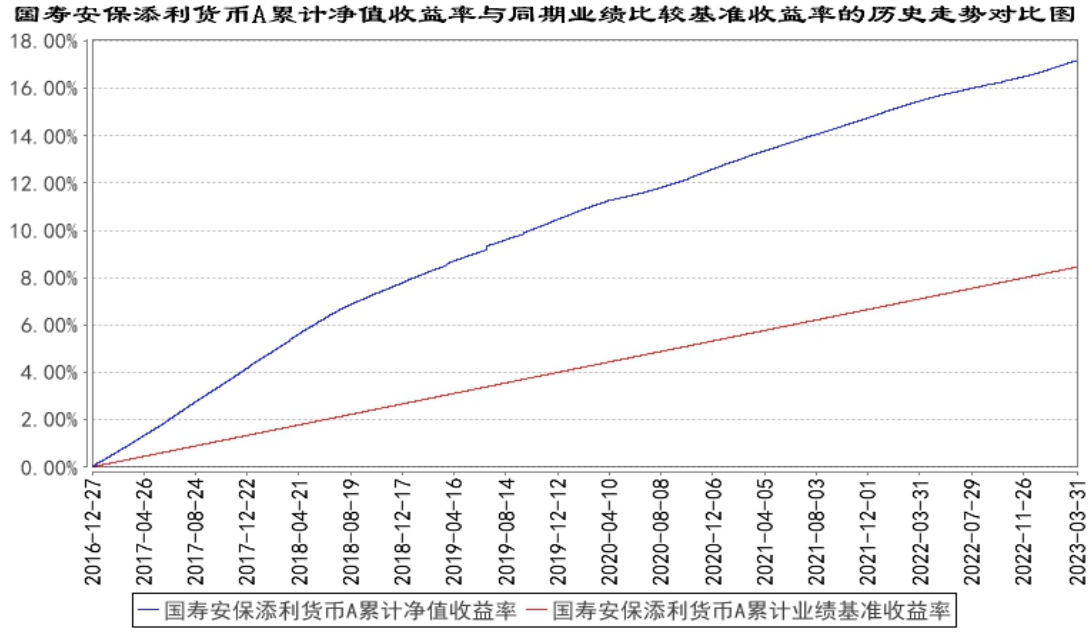
国寿安保添利货币 B

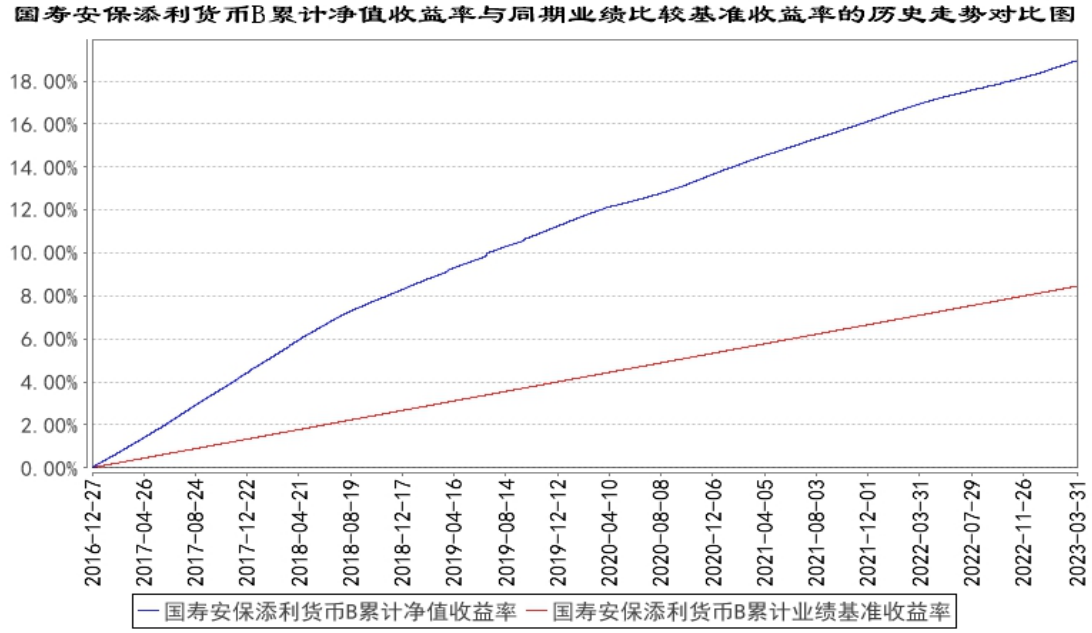
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.5076%	0.0004%	0.3329%	0.0000%	0.1747%	0.0004%
过去六个月	0.9303%	0.0016%	0.6732%	0.0000%	0.2571%	0.0016%
过去一年	1.7289%	0.0016%	1.3500%	0.0000%	0.3789%	0.0016%
过去三年	6.1459%	0.0015%	4.0472%	0.0000%	2.0987%	0.0015%
过去五年	12.5410%	0.0037%	6.7500%	0.0000%	5.7910%	0.0037%
自基金合同生效起至今	18.9522%	0.0041%	8.4513%	0.0000%	10.5009%	0.0041%

注：2023 年 1 月 16 日前，本基金每日计算收益并按月结转为基金份额；2023 年 1 月 16 日起，

本基金每日计算收益并按日结转为基金份额。

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：本基金基金合同生效日为 2016 年 12 月 27 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 2016 年 12 月 27 日至 2023 年 03 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		
桑迎	基金经理	2016 年 12 月 27 日	-	20 年	硕士研究生，2002 年 7 月至 2003 年 9 月任交通银行北京分行交易员，2004 年 11 月至 2008 年 1 月任华夏银行总行资金部交易员，2008 年 2 月至 2013 年 12 月任嘉实基金交易员、基金经理。2013 年 12 月加入国寿安保基金管理有限公司投资管理部任基金经理，现任国寿安保薪金宝货币市场基金、国寿安保添利货币市场基金、国寿安保货币市场基金和国寿安保尊弘短债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。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年 1 季度国内宏观经济温和复苏，信贷、社融和房地产等关键指标均出现不同程度反弹。尽管数据出现良好走势迹象，但是经济复苏处于初期阶段，各项经济政策仍必须维持宽松呵护经济。1 季度央行在货币政策执行中操作稳健，下调存款准备

金率以及加大投放力度，货币市场流动性维持充裕。整个季度看隔夜回购均价 1.8%，7 天回购均价 2.35%，货币市场关键性的资金指标仍维持在央行政策利率附近波动。货币市场短期资产方面，22 年 4 季度受到理财赎回等因素影响短期资产市场收益率出现调整，23 年开年后理财规模逐渐企稳并恢复增长并带动整体市场企稳，部分品种出现反弹。23 年 1 季度，3 个月期 AAA 级别存单估值收益率从季度初期的 2.2%附近一度冲击到 2.5%附近之后回落至 2.4%。短期债券方面，短期高等级信用债券收益率同样出现修复，一些前期热点债券收益率也出现企稳下行。整体看 2023 年 1 季度是债券市场稳健发展的一段时期。

2023 年 1 季度本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，结合本基金客户现金流特点，以确保组合流动性、安全性为首要任务；灵活配置债券投资保障组合充足流动性。整体看，本基金成功应对了市场和规模的波动，投资业绩平稳提高，实现了均衡安全性、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 报告期内基金的业绩表现

本报告期国寿安保添利货币 A 的基金份额净值收益率为 0.4490%，本报告期国寿安保添利货币 B 的基金份额净值收益率为 0.5076%，同期业绩基准收益率为 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	1,453,278,308.14	32.09
	其中：债券	1,453,278,308.14	32.09
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,600,163,459.72	35.34
	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	1,475,093,119.07	32.57
4	其他资产	600.00	0.00
5	合计	4,528,535,486.93	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	0.79	
	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	400,093,380.42	9.70
	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	37
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	70
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内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	45.54	9.70
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	24.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	22.26	-
	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）	17.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		109.75	9.70

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	558,503,972.03	13.53
	其中：政策性金融债	558,503,972.03	13.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	396,608,213.87	9.61
6	中期票据	-	-
7	同业存单	498,166,122.24	12.07
8	其他	-	-
9	合计	1,453,278,308.14	35.22
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名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	2303671	23 进出 671	5,000,000	497,648,852.64	12.06
2	112315096	23 民生银行 CD096	2,000,000	199,291,087.76	4.83
3	112204023	22 中国银行 CD023	2,000,000	199,228,277.24	4.83
4	012282497	22 云投 SCP023	1,000,000	103,142,431.73	2.50
5	012282672	22 云投 SCP025	1,000,000	102,966,603.78	2.50
6	112203050	22 农业银行 CD050	1,000,000	99,646,757.24	2.41
7	220404	22 农发 04	600,000	60,855,119.39	1.47
8	012380856	23 津城建 SCP010	600,000	60,222,162.12	1.46
9	072310026	23 东财证券 CP002	500,000	50,121,808.22	1.21
10	012381106	23 津城建 SCP014	500,000	50,076,479.77	1.21

5.7 “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	0.0465%
报告期内偏离度的最低值	-0.0248%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0107%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%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%情况。

5.8 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 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东方财富证券股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚；中国进出口银行、中国民生银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；中国民生银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚；中国民生银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚；中国民生银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局的处罚；中国民生银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚；中国民生银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到公安局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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	应收申购款	600.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	600.00

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

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	40,415,243.28	3,292,977,635.28
报告期期间基金总申购份额	1,012,588,588.14	23,771,713,843.08
报告期期间基金总赎回份额	516,443,198.09	23,474,874,399.55
报告期期末基金份额总额	536,560,633.33	3,589,817,078.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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	20230101~20230130,20230202~20230222,20230310~20230331	1,118,136,611.65	4,510,482,344.64	3,900,000,000.00	1,728,618,956.29	41.89
	2	20230202,20230216~20230227,20230303~20230307	-	5,003,744,732.24	5,003,744,732.24	-	-

	3	20230227	-	1,501,956,526.95	1,501,956,526.95	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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
2023 年 4 月 22 日