

国联安保本混合型证券投资基金

[2015] 第三季度报告

基金管理人:国联基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十一月二十六日

基金管理人的董事会及高级管理人员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法律法规及基金合同，于2015年10月22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。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 1 基金产品概况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------------|----------------|--------------|
| 1 | 权杖投资 | 3,869,890.02 | 3.21 |
| 2 | 境内股票 | 3,869,890.02 | 3.21 |
| 3 | 固定收益投资 | 108,016,004.80 | 89.49 |
| 4 | 其中:债券 | 108,016,004.80 | 89.49 |
| 5 | 资产支持证券 | - | - |
| 6 | 贵金属投资 | - | - |
| 7 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 8 | 境外投资 | - | - |
| 9 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 10 | 其中:质押式回购 | - | - |
| 11 | 银行存款和结算备付金合计 | 5,516,107.92 | 4.57 |
| 12 | 其他各项资产 | 3,294,246.34 | 2.73 |
| 13 | 合计 | 120,697,049.86 | 100.00 |

注:本基金采用资产配置组合策略来控制本基金管理的风险,力求在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。

基金通过CPPI(Constant Proportion Portfolio Insurance)预定比例投资组合策略,通过定期定额投资计划,在不同市场环境下,根据资产配置比例进行动态调整,以保证基金的资产安全。同时,本基金还将通过定期定额投资策略,在一定程度上保证基金分享市场整体性上涨的好处,力争在保证基金资产实现高的增值幅度。

本基金将定期在市场均衡的条件下将开放式基金持有的开放式基金资产向定期开放式基金的投

资范围内,将开放式基金的现金余额向定期开放式基金的现金余额。

业绩比较基准:定期开放式基金的平均收益率×1.2×(1-申购赎回费)。

风险收益特征:本基金为保本混合型基金,风险收益品种。

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

基金保证人:中海信托股份有限公司

§ 2 基金产品概况

基金简称:国联安保本混合

基金主代码:000068

交易代码:000068

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年4月3日

报告期末基金份额总额:60,161,169.99份

投资目标:本基金采用资产配置组合策略来控制本基金管理的风险,力求在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。

本基金通过CPPI(定期开放式基金的平均收益率×1.2×(1-申购赎回费))定期定额投资计划,在不同市场环境下,根据资产配置比例进行动态调整,以保证基金的资产安全。同时,本基金还将通过定期定额投资策略,在一定程度上保证基金分享市场整体性上涨的好处,力争在保证基金资产实现高的增值幅度。

本基金将定期在市场均衡的条件下将开放式基金持有的开放式基金资产向定期开放式基金的投

资范围内,将开放式基金的现金余额向定期开放式基金的现金余额。

业绩比较基准:定期开放式基金的平均收益率×1.2×(1-申购赎回费)。

风险收益特征:本基金为保本混合型基金,风险收益品种。

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

基金保证人:中海信托股份有限公司

§ 3 王要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 4,966,919.05

2.本期利润 1,649,433.77

3.加权平均基金份额本期利润 0.02600

4.期末基金资产净值 97,029,127.75

5.期末基金份额净值 1.204

注:1.基金三季报显示本基金本期利润收入,投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和相关费用后的余额,本期利润为本公司在当期已实现的收入扣除公允价值变动的调整。

2.上述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.本基金净值的计算方法为每万份基金资产净值=基金资产净值/基金份额。

4.本基金净值的计算方法为每万份基金资产净值=基金资产净值/基金份额。

5.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

6.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

7.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

8.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

9.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

10.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

11.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

12.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

13.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

14.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

15.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

16.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

17.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

18.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

19.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

20.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

21.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

22.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

23.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

24.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

25.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

26.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

27.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

28.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

29.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

30.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

31.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

32.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

33.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

34.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

35.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

36.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

37.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

38.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

39.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

40.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

41.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

42.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

43.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

44.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

45.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

46.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

47.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

48.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

49.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

50.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

51.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

52.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

53.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

54.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

55.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

56.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

57.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

58.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

59.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

60.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

61.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

62.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

63.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

64.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

65.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

66.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

67.基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用,例如,开放期的申购赎回费用等,计入费用后实际收益要低于所列数字。