国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§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2016年3月24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。

本报告中的财务资料经审计,毕马威华振会计师事务所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。

本报告期自2015年1月1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	国联安安心成长混合
基金主代码	253010
交易代码	253010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月13日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
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	4,299,932,937.10份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	全程风险预算,分享经济成长,追求绝对收益。
投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次通过全程的风险预算,结合数量化的金融工程模型,根据市场以及基金超额收益率的情况,进行资产配置、行业配置和不同种类债券的配置。第二个层次,在股票投资方面,以价值选股为原则,主要选取基本面好、流动性强、价值被低估的公司,在行业配置基础上进行组合管理;在债券投资方面,注重风险管理,追求稳定收益,基于对中长期宏观形势与利率走势的分析进行久期管理与类属配置,并适量持有可转换债券来构建债券组合。
业绩比较基准	为“德盛安心成长线”,“德盛安心成长线”的确定方式为在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。
风险收益特征	中低风险的基金产品,追求长期的稳定的收益。

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		国联安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	洪渊
	联系电话	021-38992806	010-66105799
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95588
传真		021-50151582	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

§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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	718,058,546.35	304,821,981.79	4,967,210.13
本期利润	733,180,373.19	383,804,411.57	-9,153,549.15
加权平均基金份额本期利润	0.1028	0.1066	-0.0317
本期基金份额净值增长率	18.81%	18.14%	-2.97%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1113	0.1196	0.0461
期末基金资产净值	2,813,428,322.72	2,531,813,242.02	742,731,361.76
期末基金份额净值	0.654	0.663	0.589

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

2.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.对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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	3.48%	0.16%	0.33%	0.00%	3.15%	0.16%
过去六个月	3.32%	0.21%	0.74%	0.00%	2.58%	0.21%
过去一年	18.81%	0.21%	1.82%	0.01%	16.99%	0.20%
过去三年	36.20%	0.70%	7.33%	0.01%	28.87%	0.69%
过去五年	26.42%	0.64%	14.08%	0.01%	12.34%	0.63%
自基金合同生效起至今	129.55%	0.83%	31.62%	0.01%	97.93%	0.82%

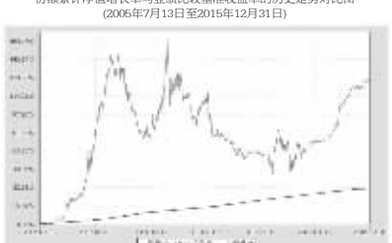
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年7月13日至2015年12月31日)



注:1、本基金的业绩基准为“德盛安心成长线”,德盛安心成长线的确定:在基金合同生效日的值为0.90 元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365;

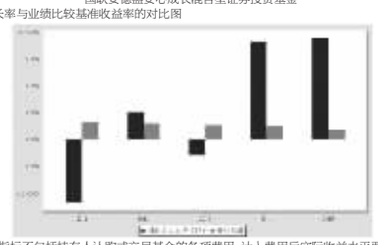
2、本基金基金合同于2005年7月13日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

3、上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。

3.2.3 过去五年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

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:上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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	1.190	590,913,854.93	100,790,404.22	691,704,259.15	-
2014	0.300	83,727,819.88	17,901,665.33	101,629,485.21	-
2013	-	-	-	-	-
合计	1.490	674,641,674.81	118,692,069.55	793,333,744.36	-

§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

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司,其中方股东为国泰君安证券股份有限公司,是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一;外方股东为德国安联集团,是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末,公司共管理二十七只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队,借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验,结合本地投资研究与客户服务的成功实践,秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念,力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安睿祺增利债券证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2014-06-21	-	14年(自2001年起)	冯俊先生,复旦大学经济学博士。曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管,光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员,长盛基金管理有限公司基金经理助理,泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理。2008年10月起加入国联安基金管理有限公司,现任债券组合管理部总监,2009年3月至2015年2月任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2010年6月至2013年7月兼任国联安信心增益债券证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理,2013年7月起任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金经理,2014年12月起兼任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理,2014年6月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年4月起兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年5月起兼任国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理,2015年6月起兼任国联安鑫安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理。2015年11月起兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理。
刘斌	本基金基金经理、兼任国联安德盛精选股票型证券投资基金、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金、国联安德盛稳健证券投资基金基金经理	2013-12-10	2015-03-06	8年(自2007年起)	刘斌,硕士研究生,2004年4月至2007年8月在杭州城建设计研究院有限公司担任工程师;2007年9月至2009年8月在群益国际投控有限公司担任行业研究员。2009年8月起加入国联安基金管理有限公司,担任研究员;2013年12月起至2015年3月担任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理,2013年12月起兼任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理,自2014年2月起至2015年12月兼任国联安德盛精选混合型证券投资基金的基金经理,2014年6月起至2015年12月兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年4月起兼任国联安德盛优势混合型证券投资基金基金经理。
吕中凡	本基金基金经理助理	2014-06-25	-	4年(自2011年起)	-
林渌	本基金基金经理助理、兼任研究部行业研究员	2015-06-04	-	4年(自2011年起)	-
周平	本基金基金经理助理	2013-12-17	2015-05-11	10年(自2005年起)	-

注:1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无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

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章,制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”),用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度,分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台,不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度,通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度,投资交易指令统一通过交易室下达,严格遵守公平交易原则,启用交易系统中的公平交易模块,按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量,交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配;对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易,以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认,确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应,并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理配定期对成交的银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等执行权;在交易环节严格按照时间优先、价格优先的原则执行指令;如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本报告期内,公司旗下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未发现有超过该证券当日成交量5%的情况。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制,对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析,未发现异常交易。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,执行了95%置信区间、假设溢价率为0的T分布检验,同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析,未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内本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

2015年,宏观经济继续下行、通胀维持低位使得货币政策继续维持宽松。尤其是接近15年下半年,由于资产荒的蔓延和机构年末提前配置的到来,利率债和一些具有政府背书的高资质债券收益率出现大幅下行。与此同时,行业景气度较差的企业债券收益率则维持高位,评级利差则出现扩大走势。四个季度GDP缩减指数为负,未来几个季度GDP缩减指数预计依然将为负。

考虑到保持基金净值增长率的平稳性,在基本配置上本基金股票维持了较低的仓位,积极参与了新股申购,将富余的资金适当的配置在了高流动性债券,取得了一定的基础性收益。同时也考虑经济的基本面因素和期限利差较高,债券收益率的下降可能进一步向长端传导,适当拉长了债券期限久期,增配了高资质债券。在债券投资和新股投资上都取得了一定正收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为18.81%,同期业绩比较基准收益率为1.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年上半年经济下行压力较大,流动性补充需求迫切,定向宽松仍是首要选项,这对债券市场基本面都还是形成支撑。股票市场经过1月的大幅下跌之后,仍难能看到系统性机会。所以本基金还是继续延续之前的投资思路,严格控制股票仓位,争取在债券市场上找到确定性机会,追求较为稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成,并根据业务分工履行相应的职责,所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值工作小组成员1/2以上多数票通过,数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致,估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策,公司和基金托管银行有充分沟通,积极商讨达成一致意见;对于估值结果,公司和基金托管银行有详细的核对流程,达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定,以及本基金实际运作情况,本基金对本报告期内利润分配情况如下,符合本基金基金合同的相关规定。

本基金以截止至2014年12月31日的可供分配利润为基准,于2015年1月19日实施分红,向截止至2015年1月16日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人,按每10份基金份额1.190元派发红利。共发放红利691,704,259.15元。

4.8 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联安德盛安心成长混合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,国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的管理人——国联安基金管理有限公司在国联安德盛安心成长混合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,国联安德盛安心成长混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为691,704,259.15元。

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

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的国联安德盛安心成长混合型证券投资基金2015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

本报告期的基金财务会计报告经毕马威华振会计师事务所审计,注册会计师王国蓉、张楠签字出具了毕马威华振审字第1600375号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:	-	-
银行存款	69,988,376.95	19,245,546.77
结算备付金	34,193,757.92	8,904,910.22
存出保证金	284,770.54	173,180.20
交易性金融资产	2,317,888,409.36	2,080,870,951.22
其中:股票投资	157,142,157.84	154,819,512.62
基金投资	-	-
债券投资	2,160,746,251.52	1,926,051,438.60
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	349,326,123.99	361,057,901.58
应收证券清算款	634,540,580.68	20,518,676.63
应收利息	47,092,343.52	46,926,615.55
应收股利	-	-
应收申购款	1,234,637.99	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	500.00	500.00
资产总计	3,454,549,500.95	2,537,698,282.17
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:	-	-
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	633,000,000.00	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,402,633.40	2,071,951.40
应付管理人报酬	3,452,142.10	2,630,385.76
应付托管费	575,357.02	438,397.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	172,962.64	293,205.41
应交税费	195,614.26	183,323.20
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	322,468.81	267,776.74
负债合计	641,121,178.23	5,885,040.15
所有者权益:	-	-
实收基金	2,334,913,312.31	2,074,788,538.20
未分配利润	478,515,010.41	457,024,703.82
所有者权益合计	2,813,428,322.72	2,531,813,242.02
负债和所有者权益总计	3,454,549,500.95	2,537,698,282.17

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.654元,基金份额总额4,299,932,937.10份。

7.2 利润表

会计主体:国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	834,164,616.66	434,202,488.72
1.利息收入	148,252,378.37	78,178,505.11
其中:存款利息收入	20,579,094.69	3,074,781.37
债券利息收入	112,500,825.61	55,009,716.91
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,172,458.07	20,094,006.83
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	663,865,798.62	273,686,779.22
其中:股票投资收益	583,659,340.00	210,654,072.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	77,453,371.43	60,869,555.33
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	2,753,087.19	2,163,151.51
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	15,121,826.84	78,982,429.78
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6,924,612.83	3,354,774.61
减:二、费用	100,984,243.47	50,398,077.15
1. 管理人报酬	66,083,825.06	33,631,118.02
2. 托管费	11,013,970.77	5,605,186.42
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,333,278.09	2,009,678.85
5. 利息支出	20,179,422.06	8,835,938.86
其中:卖出回购金融资产支出	20,179,422.06	8,835,938.86
6. 其他费用	373,747.49	316,155.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	733,180,373.19	383,804,411.57
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	733,180,373.19	383,804,411.57

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1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)	2,074,788,538.20	457,024,703.82	2,531,813,242.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	733,180,373.19	733,180,373.19
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)	260,124,774.11	-19,985,807.45	240,138,966.66
其中:1.基金申购款	5,567,571,957.07	806,567,577.96	6,374,139,535.03
2.基金赎回款	-5,307,447,182.96	-826,553,385.41	-6,134,000,568.37
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)	-	-691,704,259.15	-691,704,259.15
五、期末所有者权益(基金净值)	2,334,913,312.31	478,515,010.41	2,813,428,322.72
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	684,624,208.67	58,107,153.09	742,731,361.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	383,804,411.57	383,804,411.57
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)	1,390,164,329.53	116,742,624.37	1,506,906,953.90
其中:1.基金申购款	3,758,311,371.91	442,190,863.14	4,200,502,235.05
2.基金赎回款	-2,368,147,042.38	-325,448,238.77	-2,693,595,281.15
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)	-	-101,629,485.21	-101,629,485.21
五、期末所有者权益(基金净值)	2,074,788,538.20	457,024,703.82	2,531,813,242.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:谭晓雨,主管会计工作负责人:李柯,会计机构负责人:仲晓峰

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意德盛安心成长混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2005] 9号文)和《关于国联安德盛安心成长混合型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2005]180号文)批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2005年7月13日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为409,055,615.48份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金招募说明书》和《国联安基金管理有限公司关于德盛安心成长混合型证券投资基金基金拆分结果的公告》的有关规定,基金管理人国联安基金管理有限公司确定2008年3月12日为本基金的基金份额拆分日。当日基金资产净值为158,956,920.26元,拆分前基金份额总额为86,355,783.58份,拆分前基金份额净值为1.841元。根据基金份额拆分公式,基金份额折算比例为1.840721185,拆分后基金份额总额为158,956,920.26份,折算后基金份额净值为1.000元。国联安基金管理有限公司已根据上述拆分比例,对各基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分,并于2008年3月13日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》和《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,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股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票类资产5%-65%;债券类资产(含到期日在一年以内的政府债券)不低于20%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较标准为德盛安心成长线;该成长线按以下方法确定:在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况、2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据估值处理标准,本基金自2015年3月26日起,对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于2015年3月26日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2005]102号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]116号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

(2) 应交税费

债券利息收入所得税:2015年12月31日 195,614.26元

2014年12月31日 183,323.20元

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分

7.4.7 关联方关系

项目	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司(“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	77,067,280.17	3.97%	289,555,013.86	24.10%

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安	108,984,446.84	12.05%	331,425,489.60	26.25%

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	21,854,800,000.00	33.35%	24,718,100,000.00	48.25%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	71,772.79	4.11%	43,931.54	28.71%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	245,404.09	24.36%	10,760.45	4.02%

注:上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》,本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时,还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	66,083,825.06	33,631,118.02
其中:支付销售机构的客户维护费	4,409,960.39	2,820,630.32

注:支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资