国联安货币市场证券投资基金

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:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 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。

基金托管人上海浦东发展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	国联安货币	
基金主代码	253050	
交易代码	253050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月26日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,207,400,036.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安货币A	国联安货币B
下属分级基金的交易代码	253050	253051
报告期末下属分级基金的份额总额	86,418,359.35份	10,120,981,676.89份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式管理,定性分析与量化分析相结合,力争为投资者提供稳定的收益。
投资策略	本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测,在此基础之上,确定组合久期和类别资产配置比例,把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择,具体包括以下策略: 1、利率预期策略 2、收益率曲线策略 3、类属配置策略 4、现金流管理策略 5、套利策略 6、个券选择策略
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。

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		国联安基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	廖原
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	Liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540

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	
	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B
本期已实现收益	4,742,575.38	75,983,657.34	4,654,857.69	52,857,350.99	2,508,461.91	27,844,873.88
本期利润	4,742,575.38	75,983,657.34	4,654,857.69	52,857,350.99	2,508,461.91	27,844,873.88
本期净值收益率	3.2153%	3.4655%	3.9306%	4.1796%	3.7406%	3.9888%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B
期末基金资产净值	86,418,359.35	10,120,981,676.89	1,007,186,795.54	6,462,679,344.73	297,789,652.96	3,892,075,718.37
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注:1、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;

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益要低于所列数字。

3、本基金收益分配按日结转份额。

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

1. 国联安货币A:

3.1.1期间数据和指标	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③			
过去三个月	0.6866%	0.0026%				
过去六个月	1.4123%	0.0040%				
过去一年	3.2153%	0.0080%				
过去三年	11.2850%	0.0052%				
过去五年	-	-				
自基金合同生效起至今	18.4967%	0.0057%		6.8350%	0.0002%	11.6617%

注:1、本基金收益分配按日结转份额;

2、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。

2. 国联安货币B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7478%	0.0026%	0.3403%	0.0000%	0.4075%	0.0026%
过去六个月	1.5356%	0.0040%	0.6805%	0.0000%	0.8551%	0.0040%
过去一年	3.4655%	0.0080%	1.3500%	0.0000%	2.1155%	0.0080%
过去三年	12.0896%	0.0052%	4.0500%	0.0000%	8.0396%	0.0052%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	19.9104%	0.0057%	6.8350%	0.0002%	13.0754%	0.0055%

注:1、本基金收益分配按日结转份额;

2、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。

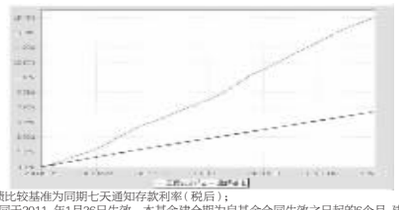
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011年1月26日至2015年12月31日)

1、国联安货币A

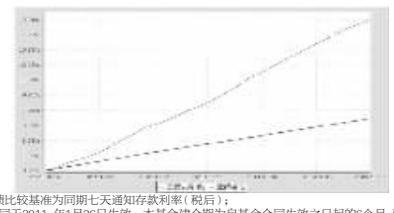


注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2011 年1月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的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。

2、国联安货币B



注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2011 年1月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

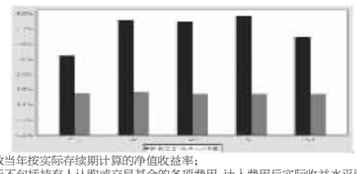
3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国联安货币市场证券投资基金

自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

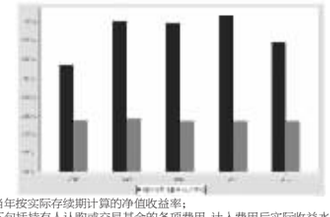
1、国联安货币A



注:1、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值收益率;

2、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。

2、国联安货币B



注:1、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值收益率;

2、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

国联安货币A:

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	4,742,575.38	-	-	4,742,575.38	-
2014	4,654,857.69	-	-	4,654,857.69	-
2013	2,508,461.91	-	-	2,508,461.91	-
合计	11,905,894.98	-	-	11,905,894.98	-

国联安货币B:

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015	75,983,657.34	-	-	75,983,657.34	-
2014	52,857,350.99	-	-	52,857,350.99	-
2013	27,844,873.88	-	-	27,844,873.88	-
合计	156,685,882.21	-	-	156,685,882.21	-

§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		
薛琳	本基金基金经理、兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-07-11	-	9年(自2006年起)	薛琳女士,管理学学士,2006年3月至2006年12月在上海红顶金融研究中心公司担任项目管理工作。2006年12月至2008年6月在上海国利货币有限公司担任债券交易员。2008年6月至2010年6月在上海长江养老保险股份有限公司担任债券交易员。自2010年6月起,加盟国联安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理职务。2012年7月起担任国联安货币市场证券投资基金基金经理。2012年12月起至2015年11月兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年6月起兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
侯慧娣	本基金基金经理、兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-12-25	-	8年(自2007年)	侯慧娣女士,理学硕士。2006年3月至2006年7月在国泰君安证券研究所从事国内债券市场数据分析与处理;2006年7月至2008年10月在世商软件(上海)有限公司从事债券分析;2009年12月至2012年9月在国信证券股份有限公司经济研究所从事债券和固定收益分析;2012年9月至2015年6月在德邦基金管理有限公司固定收益部从事研究和管理工作,期间曾担任基金经理和固定收益部副总监。2015年6月加入国联安基金管理有限公司,2015年12月起任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安货币市场证券投资基金基金经理。
吕中凡	本基金基金经理助理	2015-07-04	-	4年(自2011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;

3、薛琳女士于2016年1月15日离任,不再担任本基金基金经理(2016年1月15日公告)。

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》、《国联安货币市场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。风险管理部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机会;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年国内宏观经济呈现典型的转型期特征,经济增速继续下台阶,物价水平继续回落,受到国际大宗商品价格下跌和我国总需求疲弱的影响。制造业投资和房地产投资增速未见明显起色。 2015年货币政策非常宽松,五次降息,五次降准。国内资本市场经历较大变化,人民币利率市场化改革基本完成,8月11日人民币汇率改革实施。具体来看,2015年一季度由于人民币贬值压力叠加新股IPO发行,股市持续向好,资金持续流向打新基金、股票配资等类固定收益品种,资金面一季度居高不下,3MShibor均值一季度一直在4.9附近,短融和存款利率较高,一季度债市在经济预期悲观和货币宽松预期的带动下,长端利率先下后上。2015年二季度末股市经历去杠杆的大幅调整, IPO暂停,债市迎来避险资金配置行情,8月11日人民币汇率改革虽然依然未改债市收益率一路向下的行情。在货币政策宽松的前提下,11月份IPO重启和12月份美联储加息仅对债市造成短期扰动,之后收益率继续向下,债市完美收官。总体来看,由于1季度存款和短融收益率较高,本基金在1季度均衡配置了存款和短融,3季度随着基金规模的扩大抓住人民币汇改期间短期资金面的扰动和3季末配置了较高收益率的短融和存款,4季度IPO重启期间预期到货币基金的规模变动,在保证基金流动性的前提下,为投资人获取了超越基准的回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安货币A净值收益率为3.2153%,同期业绩比较基准增长率为1.3500%。国联安货币B净值收益率为3.4655%,同期业绩比较基准增长率为1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2016年国内经济的不确定性和资本市场的波动性将加大,在供给侧改革和去产能、去库存、去杠杆的改革前提下,国内经济仍然面临转型期持续寻底的过程。外围经济方面,美国经济预计持续复苏,美元仍然处于强势地位,日本和欧洲预计货币持续宽松,新兴经济体和资源国仍然面临货币贬值压力,人民币汇率贬值压力仍然较大。受资金外流和汇率贬值影响,货币政策宽松将受到一定制肘。经济基本面二季度之前较难看到企稳迹象,信用风险有可能继续扩大,货币市场有可能出现票据监管趋严、央行宽松对冲不及时等导致的流动性紧张,货币市场流动性紧张有可能会造成资本市场发生一系列共振的黑天鹅事件。预计央行仍将维持继续宽松的货币政策,通胀压力不大。2016年2月1日起新的货币基金管理办法将正式实施,我们认为监管部门进一步强调了基金的风险管理,包括流动性风险、利率风险、信用风险等。在基金的管理中,我们将顺应监管思路,高度重视基金的风险管理,进一步加强内控建设,力求在控制风险的基础上通过积极的主动管理为持有人贡献超额回报。

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,本基金根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,每月支付,并只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。

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。

本基金向本基金A级份额持有人共分配利润4,742,575.38元,向本基金B级份额持有人共分配利润75,983,657.34元。

§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,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对国联安货币市场基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,不存在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,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对国联安货币市场基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内,由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、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,注册会计师王国蓓、张楠签字出具了毕马威华振审字第1600372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:国联安货币市场证券投资基金

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	2,915,428,840.87	3,171,857,921.89
结算备付金	338,095.24	21,276,000.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,404,549,828.92	869,745,734.89
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,404,549,828.92	869,745,734.89
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,834,592,221.87	2,411,057,723.08
应收证券清算款	-	130,436,726.11
应收利息	50,054,954.76	22,459,777.61
应收股利	-	-
应收申购款	5,161,743.94	844,324,230.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	10,210,125,685.60	7,471,158,113.66
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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	64,860.22	31,269.38
应付管理人报酬	1,525,168.64	671,092.82
应付托管费	462,172.29	203,361.47
应付销售服务费	67,965.46	92,469.42
应付交易费用	52,796.57	16,414.61
应交税费	243,178.08	23,178.08
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	309,508.10	254,187.61
负债合计	2,725,649.36	1,291,973.39
所有者权益:	-	-
实收基金	10,207,400,036.24	7,469,866,140.27
未分配利润	-	-
所有者权益合计	10,207,400,036.24	7,469,866,140.27
负债和所有者权益总计	10,210,125,685.60	7,471,158,113.66

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额10,207,400,036.24份。其中国联安货币A份额为86,418,359.35份;国联安货币B份额为10,120,981,676.89份。

7.2 利润表

会计主体:国联安货币市场证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	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	93,331,085.28	64,669,853.83
1.利息收入	84,927,517.03	62,410,764.96
其中:存款利息收入	37,588,934.35	26,598,102.22
债券利息收入	34,830,746.61	19,799,922.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	12,507,836.07	16,012,740.30
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	8,386,623.81	2,259,088.87
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	8,386,623.81	2,259,088.87
资产支持证券投资收益	-	-
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)	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	16,944.44	-
减:二、费用	12,604,852.56	7,157,645.15
1. 管理人报酬	8,662,764.75	4,681,487.02
2. 托管费	2,625,080.18	1,418,632.49
3. 销售服务费	643,842.89	421,624.95
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	272,296.37	296,069.91
其中:卖出回购金融资产支出	272,296.37	296,069.91
6. 其他费用	400,868.37	339,830.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	80,726,232.72	57,512,208.68
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	80,726,232.72	57,512,208.68

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安货币市场证券投资基金

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)	7,469,866,140.27	-	7,469,866,140.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	80,726,232.72	80,726,232.72
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)	2,737,533,895.97	-	2,737,533,895.97
其中:1.基金申购款	23,507,994,974.34	-	23,507,994,974.34
2.基金赎回款	-20,770,461,078.37	-	-20,770,461,078.37
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)	-	-80,726,232.72	-80,726,232.72
五、期末所有者权益(基金净值)	10,207,400,036.24	-	10,207,400,036.24
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)	4,189,865,371.33	-	4,189,865,371.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,512,208.68	57,512,208.68
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)	3,280,000,768.94	-	3,280,000,768.94
其中:1.基金申购款	14,681,404,440.78	-	14,681,404,440.78
2.基金赎回款	-11,401,403,671.84	-	-11,401,403,671.84
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)	-	-57,512,208.68	-57,512,208.68
五、期末所有者权益(基金净值)	7,469,866,140.27	-	7,469,866,140.27

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

国联安货币市场证券投资基金(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”)《关于核准国联安货币市场证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]1587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《国联安货币市场证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2011年1月26日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为2,845,589,169.30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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》和《国联安货币市场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,包括现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

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相一致。

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

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生过会计差错。

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[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债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 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

2015年12月31日	243,178.08
2014年12月31日	23,178.08

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
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	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
国联安-辉石-债券分级1号特定多客户资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-中大-医药对冲1号	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-无花果稳健对冲3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-佳成灵活配置分级1号资产管理计划交行托管专户	基金管理人管理的专户产品
国联安中经安心收益二号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-明道量化股指1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金公司-工行-至恩1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金公司-工行-胜道1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-长城-债券分级1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-诚泰1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金公司-工行-枫润资产明元1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金公司-工行-明道量化股指3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金公司-工行-致远灵活配置分级5号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-鑫享-悦达醴泉1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-狄普君桐1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-盛世源量化中性阿尔法8号资管计划	基金管理人管理的专户产品
国联安基金浦发银行国联安-盛世源量化中性阿尔法5号资管计划	基金管理人管理的专户产品

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

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。

7.4.8.1.1股票交易

本报告期内与上年度可比期间,本基金与关联方无股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本报告期内与上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

本报告期内与上年度可比期间,本基金与关联方无债券交易。

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	4,426,400,000.00	100.00%	31,461,400,000.00	100.00%

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本报告期内与上年度可比期间,本基金无支付关联方的佣金。

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	8,662,764.75	4,681,487.02
其中:支付销售机构的客户维护费	396,197.85	245,937.95

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产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年