国联安睿祺灵活配置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:招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。

基金托管人招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4月8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	国联安睿祺灵活配置混合
基金主代码	001157
交易代码	001157
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月8日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,802,987,843.11份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司力争获得长期稳定的收益。
投资策略	本基金是混合型基金,根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪,综合运用定性和定量的方法,对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估,确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下,形成大类资产的配置方案。
业绩比较基准	沪深300指数×50%+上证国债指数×50%
风险收益特征	本基金属于主动式混合型证券投资基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金,通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	张燕
	联系电话	021-38992806	0755-83199084
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95555
传真		021-50151582	0755-83195201

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4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	81,355,062.24
本期利润	112,664,792.78
加权平均基金份额本期利润	0.0409
本期基金份额净值增长率	4.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0305
期末基金资产净值	1,878,106,199.95
期末基金份额净值	1.042

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。

2、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。

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。

4、本基金于2015年4月8日成立,截止至本报告期末本基金成立未满一年。

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	2.56%	0.10%	9.20%	0.84%	-6.64%	-0.74%
过去六个月	3.68%	0.11%	-6.12%	1.34%	9.80%	-1.23%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.20%	0.10%	-2.83%	1.34%	7.03%	-1.24%

注:1、本基金基金合同于2015年4月8日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

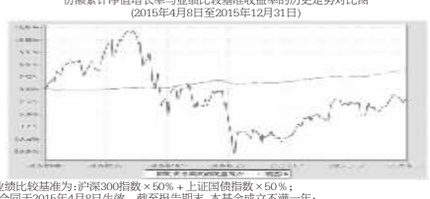
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国联安睿祺灵活配置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

(2015年4月8日至2015年12月31日)



注:1、本基金业绩比较基准为:沪深300指数×50%+上证国债指数×50%;

2、本基金基金合同于2015年4月8日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

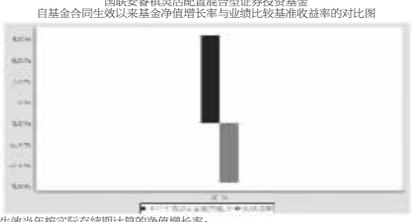
3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满半年,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

4、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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:1、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率;

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

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	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注:本基金基金合同于2015年4月8日生效,截止报告期末,本基金成立未满一年,因此无历史数据。

§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、兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)、国联安鑫安证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈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、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监。	2015-04-08	-	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3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型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月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型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。
侯慧娣	本基金基金经理、国联安货币市场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投资工作,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。
李广瑜	本基金基金经理、兼任国联安信心增益债券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、国联安保本混合型证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理	2015-06-12	-	6年(自2009年起)	李广瑜先生,硕士研究生,注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)。2005年1月至2006年8月在晨星资讯有限公司担任分析师;2006年9月至2009年8月在渣打银行有限责任公司担任国际管理培训生;2009年9月至2011年8月在海富通基金管理有限公司担任债券投资经理,2011年8月至2013年6月在太平洋产管理有限公司担任债券投资经理。2013年6月起加入国联安基金管理有限公司。2013年11月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2013年12月兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2015年3月至2015年12月兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2015年6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6月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理。2015年6月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。
周平	本基金基金经理、兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安睿安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、国联安睿享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、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安添益灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-04-08	2015-06-23	10年(自2005年起)	周平,硕士研究生,2004年8月至2005年7月在普华永道上海会计师事务所担任审计师;2006年6月至2008年4月在中信资本资产管理有限公司担任分析师,2008年5月起加入国联安基金管理有限公司,担任研究员。2014年3月至2015年6月任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年1月至2015年6月为国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年2月至2015年6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月至2015年6月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4月至2015年6月兼任国联安睿享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年6月2日至2015年6月23日兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林渌	本基金基金经理助理,兼任研究部行业研究员	2015-05-04	-	4年(自2011年起)	-
邹新进	本基金基金经理助理	2015-07-15	-	11年(自2004年起)	-
李广瑜	本基金基金经理助理	2015-05-06	2015-06-11	6年(自2009年起)	-
吕中凡	本基金基金经理助理	2015-04-09	2015-05-06	4年(自2011年起)	-

注: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、李广瑜先生于2016年3月15日离任,不再担任本基金基金经理(2016年3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》、《国联安睿祺灵活配置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主动决策,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,资金面一季度跌高不下,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,本基金在2015年上半年在保持债券一定仓位的前提下,积极参与打新,15年下半年IPO暂停后,积极加仓配置债券,11月份IPO重启后,全力参与打新,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,本基金的份额净值增长率为4.20%,同期业绩比较基准收益率为-2.83%。

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资本外流和汇率贬值压力,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,2016年央行货币政策宽松将受到一定制约。但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由于票据监管、央行宽松对冲不及时等导致的流动性紧张,这有可能会造成资本市场共振的黑天鹅事件。预计央行整体仍将维持继续宽松的货币政策,通胀压力不大。债券市场方面,经济增速放缓和通缩仍支撑债券牛市,本基金将在控制流动性风险基础上,通过严格的信用评估筛选个券,并利用较低市场利率,选择合适杠杆规模扩大收益。积极参与打新,获取新股增强收益。在保证基金流动性的前提下为投资人获取超越基准的回报。

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,本基金本报告期未进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

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

托管人声明:在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内本基金管理人在投资运作、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、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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1600383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:国联安睿祺灵活配置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
资产:	-
银行存款	11,890,981.84
结算备付金	12,322,708.84
存出保证金	158,345.40
交易性金融资产	1,719,972,518.51
其中:股票投资	96,315,914.93
基金投资	-
债券投资	1,623,656,603.58
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	120,000,300.00
应收证券清算款	524,000,000.00
应收利息	29,080,880.78
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,417,425,735.37
负债和所有者权益	**本期末 2015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	533,999,865.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	2,017,834.90
应付管理人报酬	2,429,503.97
应付托管费	404,917.31
应付销售服务费	-
应付交易费用	112,539.96
应交税费	-
应付利息	746.08
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	354,128.20
负债合计	539,319,535.42
所有者权益:	-
实收基金	1,802,987,843.11
未分配利润	75,118,356.84
所有者权益合计	1,878,106,199.95
负债和所有者权益总计	2,417,425,735.37

注:1、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.042元,基金份额总额1,802,987,843.11份。

2、本基金于2015年4月8日成立,截至本报告期末,本基金成立不满一年,无上年度末数据(下同)。

7.2 利润表

会计主体:国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	160,866,497.70
1.利息收入	69,323,614.69
其中:存款利息收入	4,448,693.23
债券利息收入	60,035,973.34
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,838,948.12
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	44,543,285.02
其中:股票投资收益	27,247,383.89
基金投资收益	-
债券投资收益	16,090,801.13
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	1,205,100.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	31,309,730.54
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	15,689,867.45
减:二、费用	48,201,704.92
1. 管理人报酬	30,489,461.46
2. 托管费	5,081,576.86
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,120,663.33
5. 利息支出	11,101,784.33
其中:卖出回购金融资产支出	11,101,784.33
6. 其他费用	408,218.94
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	112,664,792.78
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	112,664,792.78

注:本基金于2015年4月8日生效,截至本报告期末本基金成立不满一年 ,因此本报告实际报告期间为2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日;本报告无上年度可比期间数据(下同)。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月8日(基金合同生效日)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)	619,398,446.67	-	619,398,446.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	112,664,792.78	112,664,792.78
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)	1,183,589,396.44	-37,546,435.94	1,146,042,960.50
其中:1.基金申购款	4,955,253,047.35	-2,149,067.01	4,953,103,980.34
2.基金赎回款	-3,771,663,650.91	-35,397,368.93	-3,807,061,019.84
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,802,987,843.11	75,118,356.84	1,878,106,199.95

注:本基金于2015年4月8日成立。截至本报告期末,本基金成立不满一年 ,无上期可比数据。本表中“期初所有者权益(基金净值)”为基金合同生效日团2015年4月8日的数据。

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

国联安睿祺灵活配置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”)《关于核准国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2015]388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》及其他有关法律法规,基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

7.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.6 税项

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]103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]16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。

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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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
国联安-鑫尊6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-悦达鳌泉1号资产管理计划	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。

本基金于2015年4月8日成立,截至本报告期末本基金成立不满一年,无上年度可比期间数据(下同)。

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4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	720,457,658.96	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内,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4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安	398,518,756.99	100.00%

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4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	18,726,470,000.00	100.00%

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4月8日(基金合同生效日)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	648,643.81	100.00%	85,753.86	100.00%

注:股票交易佣金计提标准如下:

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1%-清算库中买(卖)经手费

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证管费

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《证券研究服务协议》,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、债券及权证交易的同时,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4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	30,489,461.46
其中:支付销售机构的客户维护费	7,917,729.73

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1.5%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×1.5%/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4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,081,576.86

注:支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国泰君安	53,307,901.37	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内,基金管理人未投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末2015年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国联安鑫尊6号资产管理计划交行托管专户	39,999,000.00	2.22%
国联安基金浦发银行国联安-鑫享-悦达鳌泉1号资产管理计划	77,238,893.88	4.28%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	11,890,981.84	4,244,237.62

注:本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2014年12月31日的相关余额为人民币12,322,708.84元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内,本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内,本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015-12-28	2016-01-06	新股待上市