国联安鑫享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: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4月28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	国联安鑫享灵活配置混合	
基金主代码	001228	
交易代码	001228	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月28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	650,198,936.41份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	001228	002186
报告期末下属分级基金的份额总额	103,820,453.95份	546,378,482.46份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来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。 在股票投资上本基金主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时,适度把握宏观经济情况进行资产配置。 在债券投资上,本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券: 1)信用等级高、流动性好; 2)资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券; 3)在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下,运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后,市场交易价格被低估的债券; 4)公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理、有一定下行保护的可转换债券。
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	较高预期风险、较高预期收益

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	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4月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C
本期已实现收益	80,843,208.26	12,810.99
本期利润	87,119,526.99	706,443.82
加权平均基金份额本期利润	0.0234	0.0014
本期加权平均净值利润率	2.32%	0.14%
本期基金份额净值增长率	2.70%	0.00%
3.1.2期末数据和指标	2015年末	
	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0206	0.0258
期末基金资产净值	106,615,066.00	560,763,956.09
期末基金份额净值	1.027	1.026

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,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

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,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、本基金基金合同于2015 年4 月28 日生效。截至报告期末,本基金成立未满1年。

5、经中国证监会批准,本基金于2015年11月28日分为A、C两类。

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

1. 国联安鑫享灵活配置混合A:

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	2.29%	0.33%	9.20%	0.84%	-6.91%	-0.51%
过去六个月	1.48%	0.26%	-6.12%	1.34%	7.60%	-1.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.70%	0.23%	-8.72%	1.37%	11.42%	-1.14%

注:1、本基金基金合同于2015年4月28日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

2、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

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. 国联安鑫享灵活配置混合C:

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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自确认C类份额起至今	0.00%	0.06%	1.18%	0.68%	-1.18%	-0.62%

注:1、本基金基金合同于2015年4月28日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

2、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

3、C类收费模式的对应基金代码为002186,自2015年12月7日起开始确认申购份额,因此,国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金C类份额的业绩表现自2015年12月7日开始计算;

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。

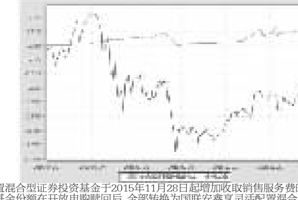
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来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28日至2015年12月31日)

1、国联安鑫享灵活配置混合A



注:1、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

2、本基金业绩比较基准为:沪深300指数×50%+上证国债指数×50%;

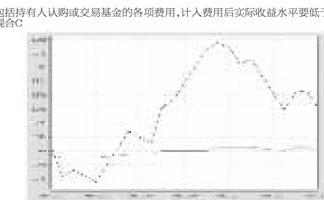
3、本基金基金合同于2015年4月28日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

4、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,2015年10月27日建仓期结束当日有两条资产配置比例被动不符合合同约定:本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的140%。除此以外,其他各项资产配置符合合同约定;

5、2015年10月27日建仓期结束当日本基金遭遇大额赎回确认,致使以上两条资产配置比例被动不达标,本基金已于2015年10月29日及时调整完毕;

6、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、国联安鑫享灵活配置混合C



注:1、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

2、C类收费模式的对应基金代码为002186,自2015年12月7日起开始确认申购份额,因此,国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金C类份额的业绩表现自2015年12月7日开始计算,其业绩比较基准收益率也自2015年12月7日开始计算;

3、本基金业绩比较基准为:沪深300指数×50%+上证国债指数×50%;

4、本基金基金合同于2015年4月28日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

5、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,2015年10月27日建仓期结束当日有两条资产配置比例被动不符合合同约定:本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的140%。除此以外,其他各项资产配置符合合同约定;

6、2015年10月27日建仓期结束当日本基金遭遇大额赎回确认,致使以上两条资产配置比例被动不达标,本基金已于2015年10月29日及时调整完毕;

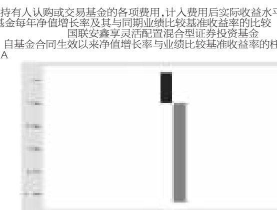
7、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、国联安鑫享灵活配置混合A



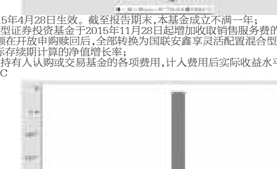
注:1、本基金基金合同于2015年4月28日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

2、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

3、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率;

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。

2、国联安鑫享灵活配置混合C



注:1、本基金基金合同于2015年4月28日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

2、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金于2015年11月28日起增加收取销售服务费的C类基金份额,并对本基金基金合同及托管协议作相应修改,原有的基金份额在开放申购赎回后,全部转换为国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金A类份额;

3、C类收费模式的对应基金代码为002186,自2015年12月7日起开始确认申购份额,因此,国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金C类份额的业绩表现自2015年12月7日开始计算;

4、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率;

5、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

本基金基金合同于2015年4月28日生效,经中国证监会批准,本基金于2015年11月28日分为A、C两类,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		
薛琳	本基金基金经理、兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理	2015-06-12	-	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月至2015年11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月起兼任国联安鑫享灵活配置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、国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、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	2015-04-28	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2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月兼任国联安鑫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)	-
王超伟	本基金基金经理助理	2015-12-08	-	1年(自2015年起)	-
薛琳	本基金基金经理助理	2015-05-08	2015-06-11	9年(自2006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》、《国联安鑫享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关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

在2015年的新股申购中,本基金获配金额在所有新股基金中排名前列。制度虽在变化,但本基金的新股定价能力具有核心优势,能根据制度的变化作出良好收益。2015年IPO暂停的四个月期间(7月6日-11月6日),在新股不能贡献收益、股市大幅波动的情况下,本基金还是获得较高债券投资收益,和同业主流产品相比处于领先地位,有效为客户减少了损失。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安鑫享灵活配置混合A的份额净值增长率为2.70%,同期业绩比较基准收益率为-8.72%。

国联安鑫享灵活配置混合C自2015年12月7日起开始确认申购份额,自确认C类份额起至本报告期期末(2015年12月7日至2015年12月31日),国联安鑫享灵活配置混合C的份额净值增长率为0.00%,同期业绩比较基准收益率为1.18%。

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年宽松仍是货币政策主基调,但是也需要看到宽松空间受到各种约束。首先是降息空间;其次是美国加息对人民币汇率将成为现实风险而非预期风险;最后是国内经济持续下行,传统行业信用风险爆发的可能性加大。2016年本基金重点还在债券收益,打新为增强收益。与2015年不同,上半年纯打新收益很高,流动性管理收益较低;而2016年的情况可能是,纯打新部分贡献的收益有限,只是作为一个增强,而债券部分的收益可能占到了大头,因此如何将债券这部分的收益做好是本基金非常重要的问题。

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

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")在对国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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1600386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:国联安鑫享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	33,562,389.92
结算备付金	624,609.31
存出保证金	276,044.23
交易性金融资产	131,900,220.45
其中:股票投资	27,968,263.32
基金投资	-
债券投资	103,931,957.13
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	430,000,000.00
应收证券清算款	77,013,752.02
应收利息	2,105,687.81
应收股利	-
应收申购款	32,667.86
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	675,515,371.60
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	7,000,000.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	98,772.73
应付管理人报酬	402,097.13
应付托管费	89,354.90
应付销售服务费	88,410.91
应付交易费用	127,565.39
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	330,148.45
负债合计	8,136,349.51
所有者权益:	-
实收基金	650,198,936.41
未分配利润	17,180,085.68
所有者权益合计	667,379,022.09
负债和所有者权益总计	675,515,371.60

注:1、报告截止日2015年12月31日,国联安鑫享混合A基金份额净值1.027元;国联安鑫享混合C基金份额净值1.026元。基金份额总额650,198,936.41份,其中国联安鑫享混合A基金份额103,820,453.95份,国联安鑫享混合C基金份额546,378,482.46份。

2、本基金于2015年4月28日成立,截至本报告期末本基金成立不满1年,无上年度末数据(下同)。

7.2 利润表

会计主体:国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年4月28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28日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	120,112,934.14
1.利息收入	56,449,674.09
其中:存款利息收入	27,437,376.51
债券利息收入	24,248,304.75
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	4,763,992.83
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	37,289,976.77
其中:股票投资收益	26,098,370.14
基金投资收益	-
债券投资收益	10,613,829.29
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	577,777.34
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6,969,951.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	19,403,331.72
减:二、费用	32,286,963.33
1. 管理人报酬	22,802,685.17
2. 托管费	5,067,263.36
3. 销售服务费	88,410.91
4. 交易费用	1,479,621.77
5. 利息支出	2,496,670.49
其中:卖出回购金融资产支出	2,496,670.49
6. 其他费用	352,311.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	87,825,970.81
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	87,825,970.81

注:本基金于2015年4月28日成立,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28日(基金合同生效日)至2015年12月31日;本基金无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年4月28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28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)	6,990,157,958.24	-	6,990,157,958.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	87,825,970.81	87,825,970.81
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)	-6,339,959,021.83	-70,645,885.13	-6,410,604,906.96
其中:1.基金申购款	1,684,436,864.58	15,882,842.16	1,700,319,706.74
2.基金赎回款	-8,024,395,886.41	-86,528,727.29	-8,110,924,613.70
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)	650,198,936.41	17,180,085.68	667,379,022.09

注:1、本基金于2015年4月28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。本表中"期初所有者权益(基金净值)"为基金合同生效日即2015年4月28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

国联安鑫享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")《关于核准国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2015]584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《国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年4月28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6,990,157,958.24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。

本基金于2015年4月21日至2015年4月23日募集,募集期间净认购资金人民币6,989,125,693.33元,认购资金在募集期间产生的利息人民币1,032,264.91元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计6,990,157,958.24份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1500371号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票投资占基金资产的0%-95%;权证投资占基金资产净值的0%-3%;在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×50%+上证国债指数×50%。

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。

根据《关于国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金增设C类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》,本基金基金管理人于2015年11月28日起对本基金增加收取销售服务费的C类基金份额并对本基金基金合同及托管协议作出相应修改。

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、自2015年4月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2015年4月28日(基金合同生效日)至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时,本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的,本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

—所转移金融资产的账面价值

—因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时,考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等),并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,没有相互抵销。但是,同时满足下列条件的,以相互抵销后的净额在资产负债表内列示:

—本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;

—本基金计划以净额结算,或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。因基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。因申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列,上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时,申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益,包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量,并于会计期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同,但本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用现金分红或红利再投资方式,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;基金份额持有人未作出选择的,本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每份基金份额每次收益分配比例不低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的50%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称"估值处理标准"),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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,暂减按25%计入应纳税所得额。自2015年9月8日起,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。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

关联方名称	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
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。

本基金于2015年4月28日成立,截至本报告期末本基金成立不满1年,无上年度可比期间数据(下同)。

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4月28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	932,366,953.06	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28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	380,291,950.31	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28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	10,370,200,000.00	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28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	848,398.54	100.00%	119,031.69	100.00%

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4月28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	22,802,685.17
其中:支付销售机构的客户维护费	268,911.24

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的0.90%年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。计算公式为:每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.90%/当年天数。本基金于2015年4月28日成立,无上年度可比数据。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年4月28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	5,067,263.36

注:支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。计算公式为:每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。本基金于2015年4月28日成立,无上年度可比数据。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年4月28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销售服务费		
	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C	合计
国联安基金管理有限公司	-	88,410.91	88,410.91
合计	-	88,410.91	88,410.91

注:支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。计算公式为:每日应计提的基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。本基金于2015年4月28日成立,无上年度可比数据。

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28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	20,132,410.49	20,656,535.08	-	-	-	-
上海浦东发展银行	72,053,630.27	101,055,378.69	-	-	-	-

注:本基金于2015年4月28日成立,无上年度可比数据。

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。

7.4.8.5 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28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
浦发银行	33,562,389.92	23,629,440.78

注:本基金于2015年4月28日成立,无上年度可比数据。本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管,按银行同业利率计息。本基金通过"浦发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2015年12月31日的相关余额为人民币624,609.31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参与认购关联方承销的证券。

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	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-
300488	恒锋工具	2015-06-25	2016-07-01	新股锁定	20.11	88.80	71,341	1,434,667.51	6,335,080.80	-
7.4.9.1.2 受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新债待上市	100.00	99.99	6,520	651,957.13	651,957.13	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2015-12-29	重大事项	11.00	2016-01-07	9.40	70,000.00	872,200.00	770,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事证银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元,因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为7,000,000.00元,于2016年1月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	27,968,263.32	4.14
	其中:股票	27,968,263.32	4.14
2	固定收益投资	103,931,957.13	15.39
	其中:债券	103,931,957.13	15.39
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	430,000,000.00	63.66
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	34,186,999.23	5.06
7	其他各项资产	79,428,151.92	11.76
8	合计	675,515,371.60	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,715,000.00	0.56
C	制造业	17,547,312.26	2.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,857,100.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,246,851.06	0.34
J	金融业	2,602,000.00	0.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,968,263.32	4.19

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

8.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300488	恒锋工具	71,341	6,335,080.80	0.95
2	002396	星网锐捷	130,000	3,139,500.00	0.47
3	601857	中国石油	300,000	2,505,000.00	0.38
4	000651	格力电器	100,000	2,235,000.00	0.33
5	600637	东方明珠	55,000	2,083,950.00	0.31
6	000063	中兴通讯	100,000	1,863,000.00	0.28
7	601398	工商银行	400,000	1,832,000.00	0.27
8	002008	大族激光	60,000	1,553,400.00	0.23
9	002098	浔兴股份	100,000	1,546,000.00	0.23
10	601898	中煤能源	200,000	1,210,000.00	0.18

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000625	长安汽车	75,292,865.68	11.28
2	600664	哈药股份	50,039,476.00	7.50
3	600829	人民同泰	36,446,221.00	5.46
4	601166	兴业银行	33,131,755.66	4.96
5	601009	南京银行	32,890,047.65	4.93
6	600016	民生银行	31,889,027.70	4.78
7	601328	交通银行	31,490,681.95	4.72
8	601818	光大银行	31,342,075.84	4.70
9	002340	格林美	30,855,050.67	4.62
10	601985	中国核电	23,148,170.91	3.47
11	000001	平安银行	11,423,280.60	1.71
12	002142	宁波银行	11,383,191.76	1.71
13	601021	春秋航空	6,624,410.00	0.99
14	002098	浔兴股份	5,769,925.00	0.86
15	002714	牧原股份	5,550,109.60	0.83
16	000902	新洋丰	5,235,048.42	0.78
17	600639	浦东金桥	3,874,504.94	0.58
18	603566	普莱柯	3,778,120.00	0.57
19	600584	长电科技	3,684,129.00	0.55
20	002396	星网锐捷	3,671,911.00	0.55

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601985	中国核电	94,436,182.64	14.15
2	000625	长安汽车	49,472,116.27	7.41
3	600664	哈药股份	40,164,735.52	6.02
4	601009	南京银行	34,360,418.24	5.15
5	601166	兴业银行	33,446,570.44	5.01
6	601818	光大银行	32,404,149.65	4.86
7	600016	民生银行	31,726,491.20	4.75
8	601328	交通银行	31,639,588.00	4.74
9	600829	人民同泰	27,235,791.00	4.08
10	002340	格林美	19,550,000.00	2.93
11	002142	宁波银行	8,525,866.18	1.28
12	000001	平安银行	7,866,955.00	1.18
13	601021	春秋航空	6,090,103.00	0.91
14	000902	新洋丰	5,257,295.00	0.79
15	002714	牧原股份	5,241,133.00	0.79
16	600584	长电科技	4,738,809.00	0.71
17	002098	浔兴股份	4,115,069.00	0.62
18	603566	普莱柯	3,985,530.00	0.60
19	600639	浦东金桥	3,826,729.92	0.57
20	002538	司尔特	3,339,288.00	0.50

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	481,167,047.19
卖出股票的收入(成交)总额	485,110,139.70

注:不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,751,000.00	3.11
5	企业短期融资券	40,147,000.00	6.02
6	中期票据	42,382,000.00	6.35
7	可转债(可交换债)	651,957.13	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	103,931,957.13	15.57

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101463005	14扬城建MTN001	100,000	11,146,000.00	1.67
2	101553006	15铁道MTN001	100,000	10,728,000.00	1.61
3	101552020	15瘦西湖MTN001	100,000	10,431,000.00	1.56
4	122377	14首开债	100,000	10,395,000.00	1.56
5	112247	15华东债	100,000	10,356,000.00	1.55

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。若投资国债期货,在国债期货投资上,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关的投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	276,044.23
2	应收证券清算款	77,013,752.02
3	应收股利	-
4	应收利息	2,105,687.81
5	应收申购款	32,667.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,428,151.92

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300488	恒锋工具	6,335,080.80	0.95	新股锁定

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国联安鑫享灵活配置混合A	702	147,892.38	42,490,913.49	40.93%	61,329,540.46	59.07%
国联安鑫享灵活配置混合C	15	36,425,232.16	546,312,690.53	99.99%	65,791.93	0.01%
合计	717	906,832.55	588,803,604.02	90.56%	61,395,332.39	9.44%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安鑫享灵活配置混合A	-	-
	国联安鑫享灵活配置混合C	9.70	0.00%
	合计	9.70	0.00%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为0;本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国联安鑫享灵活配置混合A	国联安鑫享灵活配置混合C
基金合同生效日(2015年4月28日)基金份额总额	6,990,157,958.24	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,138,045,124.99	546,391,739.59
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,024,382,629.28	13,257.13
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	103,820,453.95	546,378,482.46

注:注:1、本基金基金合同于2015年4月28日生效。

2、总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额;总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2015年6月6日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起谭晓雨女士担任我司总经理一职。公司董事长庹启斌先生不再代为履行总经理职责。上述事项已经2015年4月7日召开的国联安基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议审议通过。

2. 2015年8月22日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。经国联安基金管理有限公司第四届董事会第十七次会议审议通过,自该日起周浩先生不再担任公司督察长一职,由公司总经理谭晓雨女士代为履行督察长职责。

3. 2015年6月12日,基金管理人发布《国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》。增聘薛琳女士担任本基金的基金经理。

4. 2015年6月23日,基金管理人发布《国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》。周平先生不再担任本基金的基金经理。

5. 经基金托管人决定,邓从国同志自2015年4月1日起担任资产托管与养老金业务部总经理职务。

6. 自2016年1月起,基金托管人更新了组织架构并调整部门名称,聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金报告年度支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为6.5万元人民币,目前该事务所已向本基金提供连续1年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	932,366,953.06	100.00%	848,398.54	100.00%	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序

(1)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用,选用标准为:

A 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范,近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求,并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后,与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议,通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名:

A 提供的研究报告质量和数量;

B 研究报告被基金采纳的情况;C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;

E 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名,同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单,基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求,基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本基金的交易单元均为本期新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	380,291,950.31	100.00%	10,370,200,000.00	100.00%	-	-

国联安基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日