

信息披露 disclosure

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金

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

基金管理人、基金托管人、基金销售机构等不存在虚假记载、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。基金托管人中国银行股份有限公司已于2016年3月28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,为投资者提供真实、准确、完整、及时的信息披露资料。

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,应当阅读年度报告正文。本报告中的财务资料经审计,华诚瑞和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。本报告自2016年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

基金名称	国联安中证股债动态策略指数证券投资基金
基金代码	000060
交易代码	000060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月20日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,597,766,419
基金合同存续期限	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争基金净值增长率与标的指数收益率之间的日均跟踪偏离度不超过0.25%,年跟踪误差控制在0.5%以内,力争实现长期稳定的增值,谋求超越业绩比较基准的长期投资回报。
投资策略	本基金进行被动式指数化投资,其中,除对跟踪标的基金资产之外,其余基金资产严格按照标的指数的构成比例投资于与标的基金资产的行业分布一致,且流动性良好的股票和债券资产。对于标的股票资产,本基金采用完全复制的方法,进行被动投资,在于“跟踪标的指数”的基础上,主要通过对标的指数的构成成分证券通过买入或卖出该成分证券的方式进行投资,旨在综合考虑流动性、收益性、基金申购赎回资金需求等因素,对标的指数成份股进行适当调整,以期实现紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。对于标的债券资产,本基金采用买入并持有的策略,在综合考虑流动性、收益性、基金申购赎回资金需求等因素,对标的指数成份债进行适当调整,以期实现紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金采用量化投资,组合风险管理,交易策略选择等相关投资组合类型的投资策略,力求实现基金资产的增值。
业绩比较基准	95%×中证股债动态策略指数收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动式指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险收益特征与市场指数基金类似。

2.3 基金管理人及基金托管人		高于沪市总市值和流动性基金。	
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	中国银行股份有限公司
负责人	姓名	陆磊	田青
联系电话	电话	021-38922866	010-67596066
电子邮箱	电子邮箱	customer-service@uolink-alliance.com	banking@boc.com.cn
客户服务电话		021-38922866/4008800099	
传真		021-50161582	010-66276833
2.4 信息披露方式			
基金年度报告披露的互联网网址		http://www.guilian.com.cn/www.wip-fund.com	

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年度末2014年12月31日
本期已实现收益	3,251,412.83	2,930,416.41	2,061,039.88
本期利润	-304,348.82	6,263,309.14	2,337,968.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0932	0.0866	0.0124
基金净值增长率	-15.31%	25.27%	0.00%
3.1.2 期间费用	2015年	2014年	2013年
期间费用	10,722.21	0.0024	0.0008
基金管理人报酬	3,861,124.22	51,886,667.30	129,856,616.91
基金托管人报酬	1,073	1,287	1,009
注:1、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。			
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、加权平均基金份额本期利润,采用期末资产净值减去年初资产净值与未分配利润中归属于已实现部分的孰孰数。			
4、本基金基金合同于2015年6月20日生效,截止本报告期末,本基金尚未成立不满一年。			

注:1.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。	注: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。	注:3.过去三年基金业绩评价
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩评价	自基金合同生效以来基金业绩评价	自基金合同生效以来基金业绩评价
注:1.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。	注:1.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。	注:1.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。
注: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。	注: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。	注: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。
注:3.过去三年基金业绩评价	注:3.过去三年基金业绩评价	注:3.过去三年基金业绩评价

注:1、基金合同生效当年按实际存续期间计算,不补追刚生效时的净值增长。			
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、过去三年基金业绩评价			

注:1、基金合同生效当年按实际存续期间计算,不补追刚生效时的净值增长。			
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、过去三年基金业绩评价			

注:1、基金合同生效当年按实际存续期间计算,不补追刚生效时的净值增长。			
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、过去三年基金业绩评价			

注:1、基金合同生效当年按实际存续期间计算,不补追刚生效时的净值增长。			
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、过去三年基金业绩评价			

费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本基金财务报告等信息内容的真实、准确和完整发表意见。本报告期内,基金托管人中国银行股份有限公司已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。

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.1 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.2 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.3 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.4 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.5 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.6 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.7 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.8 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.9 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.10 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.11 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.12 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.13 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.14 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.15 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.16 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.17 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.18 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.19 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.20 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.21 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.22 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.23 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.24 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.25 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.26 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.27 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.28 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.29 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.30 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.31 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.32 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.33 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.34 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.35 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.36 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.37 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.38 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.39 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.40 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.41 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

7.42 资产状况

本报告期内,基金管理人按照中国证监会核准的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金销售协议等文件,依法合规地开展基金业务,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

关联方名称	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
成交金额	16,390,127.12	54,028,750.97
占当期债券成交金额的比例	100.00%	100.00%

7.4.1.4 债券回购交易

关联方名称	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
成交金额	-	1,000,000.00
占当期债券成交金额的比例	-	100.00%

7.4.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期佣金	21,907.07	1,496.22
占当期佣金总额的比例	100.00%	100.00%

注:上述佣金参照市场中间价由本基金的基金管理人向与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券交易经手费后的净额列示。

7.4.2 关联方交易

7.4.2.1 关联方交易

7.4.2.2 关联方交易

7.4.2.3 关联方交易

7.4.2.4 关联方交易

7.4.2.5 关联方交易

7.4.2.6 关联方交易

7.4.2.7 关联方交易

7.4.2.8 关联方交易

7.4.2.9 关联方交易

7.4.2.10 关联方交易

7.4.2.11 关联方交易

7.4.2.12 关联方交易

7.4.2.13 关联方交易

7.4.2.14 关联方交易

7.4.2.15 关联方交易

7.4.2.16 关联方交易

7.4.2.17 关联方交易

7.4.2.18 关联方交易

7.4.2.19 关联方交易

7.4.2.20 关联方交易

7.4.2.21 关联方交易

7.4.2.22 关联方交易

7.4.2.23 关联方交易

7.4.2.24 关联方交易

7.4.2.25 关联方交易

7.4.2.26 关联方交易

7.4.2.27 关联方交易

7.4.2.28 关联方交易

7.4.2.29 关联方交易

7.4.2.30 关联方交易

7.4.2.31 关联方交易

7.4.2.32 关联方交易

7.4.2.33 关联方交易

7.4.2.34 关联方交易

7.4.2.35 关联方交易

7.4.2.36 关联方交易

7.4.2.37 关联方交易

7.4.2.38 关联方交易

7.4.2.39 关联方交易

7.4.2.40 关联方交易

7.4.2.41 关联方交易

7.4.2.42 关联方交易

7.4.2.43 关联方交易

7.4.2.44 关联方交易

7.4.2.45 关联方交易

7.4.2.46 关联方交易

7.4.2.47 关联方交易

7.4.2.48 关联方交易

7.4.2.49 关联方交易

7.4.2.50 关联方交易

7.4.2.51 关联方交易

7.4.2.52 关联方交易

7.4.2.53 关联方交易

7.4.2.54 关联方交易