

国联安德盛稳健证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性承担个别及连带责任。

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4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称		国联安德盛稳健混合
基金主代码		260001
交易代码		260001(后端)
基金运作方式		契约型开放式
基金份额上市交易日		2003年8月18日
报告期末基金份额总额		1,363,208,700.00份
投资目标		本基金通过精选行业，合理配置股票与债券资产，力争在控制风险的前提下，追求长期稳定的资本增值。
投资策略		本基金通过精选行业，合理配置股票与债券资产，力争在控制风险的前提下，追求长期稳定的资本增值。
业绩比较基准		沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征		本基金属中低风险品种，其对应的特征是长期平均回报率适中，介于单只股票型基金与债券型基金之间，也介于单只的长债基金与单只的偏股型基金之间。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)	
1.本期已实现收益	-10,717,264.03	2.本期利润	-20,403,211.04
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1252	4.期末基金份额净值	1,379,742,309.07
5.期末未分配利润	1,600		

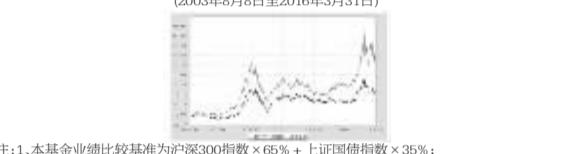
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的差额；

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水平将低于所示数字。

3.基金净值表现指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安德盛稳健证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2003年8月日至2016年3月31日)



注:1.本基金业绩比较基准为沪深300指数×65%+上证国债指数×35%；

2.本基金合同于2003年8月8日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月内，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，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2.1 本报告期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

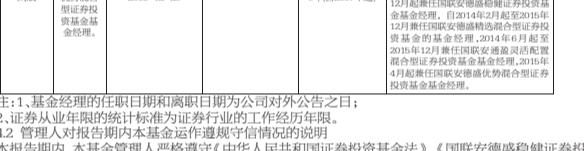
阶段 净值增长(%) 超额收益(%) 基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -13.29% 2.28% -3.93% 15.06% -4.03% 0.70%

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，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

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

国联安德盛稳健证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2003年8月日至2016年3月31日)



注:1.本基金业绩比较基准为沪深300指数×65%+上证国债指数×35%；

2.本基金合同于2003年8月8日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月内，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，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理助理)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
刘斌	本基金基金经理,兼 任德盛优势 混合基金经理 助理	2013-12-28	-	9年(自2007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经营年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安德盛稳健证券投资基金合同》及其他有关法律法规、基金业协会颁布的规范性文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，严格控制风险，充分保护基金份额持有人的合法权益。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度执行的情况

本基金严格按照相关法律法规的规定，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》，以下称“公平交易制度”，并按照包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行及投资管理在内的公平交易制度执行流程，采用系统化的方法进行公平交易。

本基金报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，对不同投资组合之间的交易行为进行了公平对待，没有发现不公平交易和利益输送的情况。

本基金报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，对不同投资组合之间的交易行为进行了公平对待，没有发现不公平交易和利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.3.3 相互交易的专项说明

本基金报告期内未发现有明显异常交易行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内，本基金的份额净值增长率为-13.29%，同期业绩比较基准收益率为-8.36%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	110,476,402.03	6.26
2	固定收益投资	110,476,402.03	6.26
3	定期存款	71,316,301.20	4.04
4	现金类资产	71,316,301.20	4.04
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	1,081,146,409.10	89.61
9	其他各项资产	1,461,206.76	0.08
10	合计	1,764,390,306.00	100.00

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差额；

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，例如：开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2.1 本报告期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

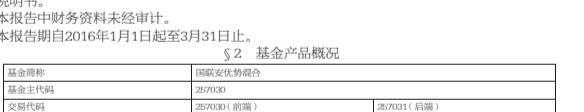
阶段 净值增长(%) 超额收益(%) 基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -14.50% 3.88% -8.13% 1.37% -6.33%

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，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

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

国联安德盛稳健证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2003年8月日至2016年3月31日)



注:1.本基金业绩比较基准为沪深300指数×65%+上证国债指数×35%；

2.本基金合同于2003年8月8日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月内，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，计价费用后实际收益水平将低于所示数字。

3.2.3 本报告期基金的业绩表现

本基金报告期内，本基金的份额净值增长率为-13.29%，同期业绩比较基准收益率为-8.36%。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件

6.2 备查文件

6.3 备查文件

6.4 备查文件

6.5 备查文件

6.6 备查文件

6.7 备查文件

6.8 备查文件

6.9 备查文件

6.10 备查文件

6.11 备查文件

6.12 备查文件

6.13 备查文件

6.14 备查文件

6.15 备查文件

6.16 备查文件

6.17 备查文件

6.18 备查文件

6.19 备查文件

6.20 备查文件

6.21 备查文件

6.22 备查文件

6.23 备查文件

6.24 备查文件

6.25 备查文件

6.26 备查文件

6.27 备查文件

6.28 备查文件

6.29 备查文件

6.30 备查文件

6.31 备查文件

6.32 备查文件

6.33 备查文件

<p