国联安信心增长债券型证券投资基金

2017 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：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年四月二十二日

§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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安信心增长债券	
基金主代码	253060	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年7月29日	
报告期末基金份额总额	422,275,011.11份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得最大化的债券收益；并通过适当参与新股发行申购及增发新股申购等较低风险投资品种，力争获取超额收益。	
业绩比较基准	中证全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
下属分级基金的交易代码	253060	253061
报告期末下属分级基金的份额总额	419,433,563.79份	2,841,447.32份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年1月1日-2017年3月31日）	
	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
1.本期已实现收益	-11,177,784.33	-53,932.23
2.本期利润	-2,378,075.97	-10,187.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0033	-0.0033
4.期末基金资产净值	431,355,113.28	2,909,253.58
5.期末基金份额净值	1.028	1.024

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。

3.2 基金净值表现

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

1、国联安信心增长债券A：

阶段	净值增长率①	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	-0.19%	0.10%	-0.33%	0.07%	0.14%	0.03%

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、国联安信心增长债券B：

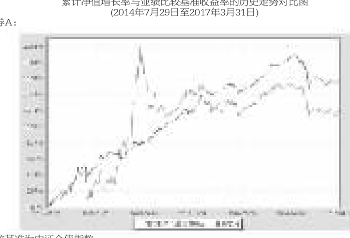
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.29%	0.11%	-0.33%	0.07%	0.04%	0.04%

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金转型以来基金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

国联安信心增长债券型证券投资基金
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
(2014年7月29日至2017年3月31日)

1. 国联安信心增长债券A：

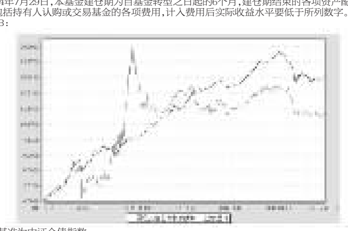


注：1、本基金的业绩比较基准为中证全债指数；

2、本基金转型日期为2014年7月29日，本基金建仓期为自基金转型之日起的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. 国联安信心增长债券B：



注：1、本基金的业绩比较基准为中证全债指数；

2、本基金转型日期为2014年7月29日，本基金建仓期为自基金转型之日起的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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超伟	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、国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安锐意成长混合型证券投资基金基金经理。	2016-06-16	-	9年（自2008年起）	王超伟，硕士研究生。2008年7月至2011年8月在国泰君安证券股份有限公司证券及衍生品投资总部任投资经理。2011年8月至2015年9月在国泰君安证券股份有限公司权益投资部任投资经理。2015年9月加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2016年2月起担任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年6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。2017年1月起兼任国联安锐意成长混合型证券投资基金基金经理。
吴昊	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、国联安保本混合型证券投资基金基金经理、国联安安稳保本混合型证券投资基金基金经理。	2015-11-27	-	8年（自2009年起）	吴昊，男，博士研究生。2009年7月至2013年6月在齐鲁证券有限公司从事研究工作。2013年6月至2015年6月在光大证券股份有限公司从事研究工作。2015年7月起加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2015年10月起任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。2015年11月起任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理。2015年11月起任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2016年3月起兼任国联安安稳保本混合型证券投资基金基金经理。

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》、《国联安信心增长债券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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2017年1季度生产面表现较好，地产、基建 的投资增速尽管回落，但仍有较大的正面贡献。此外，从2016下半年开始，经济内生动力持续复苏。2017年1季度工业生产活动继续复苏，PMI指标自2016年3月份以来持续维持在荣枯线以上，工业企业利润一季度同比表现较好。PPI持续正增长，预计未来会有所回落。CPI较低，预计未来有所回升，保持温和上涨势态。从前1-2月份数据来看，经济增长的惯性仍然较强，1季度数据表现较强。从政策面看，在短期宏观经济的下行压力不大的情况下，货币政策可能仍然保持紧平衡状态。此外，美联储加息对央行货币政策仍会有较大制约。整体来看，央行的货币政策仍然偏紧。

2017年1季度债市收益率先下后上，振幅很大。在所有债券品种中，长期利率债表现较差，短期限债券表现相对较好；此外，城投债表现一般，产业债仍然分化严重。自2016年4季度以来，监管思路表现出较明显地去杠杆、去资产泡沫，央行提高了公开市场的资金利率，因此一季度长期利率债波动较大。此外，3月底部分民企信用风险又引起市场关注，市场上有信用担忧的信用债的利差持续高位。行业景气度较差的企业债券收益率维持高位，信用利差继续走扩。通常而言，2季度信用债评级调整较多，因此未来信用债的分化可能仍会较大。

本基金在1季度继续持有高资质低风险信用债。本基金组合配置以中等级国企信用债配置为主，仓位较低，不使用杠杆套息。

权益市场在1季度表现差异较大，业绩较好的白马蓝筹受到市场追捧。本基金的权益投资在1季度权益仓位较低，通过精选个股来获取相对稳健收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安信心增长债券A的份额净值增长率为-0.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.33%；国联安信心增长债券B的份额净值增长率为-0.29%，同期业绩比较基准收益率为-0.33%。

§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	30,562,000.00	7.01
	其中：股票	30,562,000.00	7.01
2	固定收益投资	376,168,685.00	86.26
	其中：债券	376,168,685.00	86.26
	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	17,000,000.00	3.90
	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	2,965,087.52	0.68
7	其他各项资产	9,400,132.80	2.16
8	合计	436,095,905.32	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,562,000.00	7.04
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	30,562,000.00	7.04

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600138	中青旅	1,400,000	30,562,000.00	7.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	35,981,900.00	8.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,996,000.00	0.46
	其中：政策性金融债	1,996,000.00	0.46
4	企业债券	227,082,640.60	52.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	99,717,000.00	22.96
7	可转债（可交换债）	11,391,144.40	2.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	376,168,685.00	86.62

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	101576002	15义国资运MTN001	400,000	40,344,000.00	9.29
2	101552039	15渝兴永MTN001	300,000	29,856,000.00	6.88
3	101656036	16西安世园MTN001	300,000	29,517,000.00	6.80
4	019539	16国债11	290,000	28,982,600.00	6.67
5	127455	16广陵债	300,000	28,431,000.00	6.55

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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，没有相关投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 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，没有相关投资评价。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，以及经核实托管人提供的信息，本基金投资的前十名证券的发行主体中除14西南02外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

14西南02（122404）的发行主体西南证券股份有限公司于2016年6月24日发布公告称，其于2016年6月23日收到中国证券监督管理委员会重庆监管局的《关于对西南证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（行政监管措施决定书【2016】11号），要求在限期内对风险控制指标不符合规定的情形予以改正，并对信息披露进行整改。

14西南02（122404）的发行主体西南证券股份有限公司于2017年3月18日发布公告称，其于2017年3月17日收到《中国证券监督管理委员会调查通知书》，因其在从事上市公司并购重组财务顾问业务活动中涉嫌违反证券法律法规被证监会立案调查。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	133,996.61
2	应收证券清算款	3,016,666.66
3	应收股利	-
4	应收利息	6,249,469.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,400,132.80

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113009	广汽转债	2,210,075.00	0.51
2	110032	三一转债	1,542,623.40	0.36
3	110035	白云转债	1,286,600.00	0.30
4	110033	国贸转债	1,149,100.00	0.26
5	128013	洪涛转债	182,652.80	0.04
6	128009	歌尔转债	129,340.00	0.03
7	127003	海印转债	85,320.00	0.02

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
本报告期期初基金份额总额	998,964,098.35	3,169,102.28
报告期基金总申购份额	34,359.54	44,396.09
减：报告期基金总赎回份额	579,564,894.10	372,051.05
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	419,433,563.79	2,841,447.32

注：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。

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	国联安信心增长债券A	国联安信心增长债券B
报告期期初管理人持有的本基金份额	48,595,775.12	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	48,595,775.12	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	11.51	-

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年3月31日	460,404,235.73	-	143,780,488.00	316,623,747.73	74.98%
机构	2	2017年1月1日至2017年3月12日	472,142,587.35	-	434,632,000.00	37,510,587.35	8.88%

产品特有风险

（1）持有份额比例较高的投资者（"高比例投资者"）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。

（2）基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

（3）基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准国联安信心增长债券型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安信心增长债券型证券投资基金基金合同》
3、《国联安信心增长债券型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安信心增长债券型证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

9.2存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

9.3查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日

国联安中证医药100指数证券投资基金

2017 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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年四月二十二日

§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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安医药100指数
基金主代码	000059
交易代码	000059
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	1,973,010,038.55份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，为投资者提供一个投资中证医药100指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对中证医药100指数的有效跟踪。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证医药100指数收益率+5%×活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年1月1日-2017年3月31日）
1.本期已实现收益	-13,668,352.53
2.本期利润	13,060,833.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0067
4.期末基金资产净值	1,964,792,748.51
5.期末基金份额净值	0.996

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。

3.2 基金净值表现

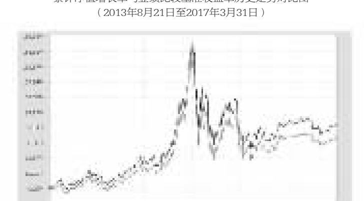
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	0.71%	0.64%	0.90%	0.68%	-0.19%	-0.04%

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

国联安中证医药100指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2013年8月21日至2017年3月31日）



注：1、本基金业绩比较基准为：95%×中证医药100指数收益率+ 5%×活期存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于2013年8月21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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理	2016-08-19	-	15年（自2002年起）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士。2003年10月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理，2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理。

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》、《国联安中证医药100指数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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2017年1季度，大宗商品价格保持了去年年底的强势，从投资、出口和消费数据来看，国内的宏观经济有所改善，房价的再此快速拉升导致多个城市继续出台抑制房价的调控政策，预计地产销售的将持续下滑，传统工业经济将继续面临下行压力。1季度股市保持上涨态势，但大小盘股分化较大。整个季度沪深300指数上涨约4.41%，而医药股表现相对不佳，1季度中证医药100指数上涨约0.94%。

依据基金合同的约定，中证医药100指数基金保持合理的仓位，采用完全复制的方法跟踪中证医药100指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为0.996元，本报告期份额净值增长率为0.71%，同期业绩比较基准收益率为0.90%。本报告期内，日均跟踪偏离度为0.05%，年化跟踪误差为1.04%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

§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	1,721,178,313.17	87.48
	其中：股票	1,721,178,313.17	87.48
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	245,026,734.79	12.45
7	其他各项资产	1,210,305.29	0.06
8	合计	1,967,415,353.25	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,257,669.95	0.17
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	1,724,625.54	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	4,982,295.49	0.25

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,411,943,127.99	71.86
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	196,747,519.50	10.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,180,628.00	0.72
J	金融业	-	-
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	16,486,636.40	0.84
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	76,838,105.79	3.91
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,716,196,017.68	87.35

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.3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。

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600161	天坛生物	607,952	24,117,455.84	1.23
2	000963	华东医药	245,379	22,734,364.35	1.16
3	600056	中国医药	957,137	22,626,718.68	1.15
4	000028	国药一致	299,437	22,541,617.36	1.15
5	000538	云南白药	256,731	21,852,942.72	1.11
6	600196	复星医药	772,154	21,790,185.88	1.11
7	002589	瑞康医药	529,864	21,735,021.28	1.11
8	300142	沃森生物	1,591,201	20,765,173.05	1.06
9	601607	上海医药	883,419	20,592,496.89	1.05
10	600276	恒瑞医药	377,442	20,506,423.86	1.04

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600812	华北制药	531,309.00	3,256,924.17	0.17
2	603939	益丰药房	59,103.00	1,724,625.54	0.09
3	600664	哈药股份	98.00	745.78	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告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。

5.7 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。

5.8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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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，没有相关投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 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，没有相关投资评价。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，以及经核实托管人提供的信息，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。

5.11.2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。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	582,054.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	64,069.76
5	应收申购款	564,181.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,210,305.29

5.11.4报告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换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,920,363,107.06
报告期基金总申购份额	75,273,744.35
减：报告期基金总赎回份额	22,626,812.86
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,973,010,038.55

注：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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年3月31日	1,305,969,527.36	-	-	1,305,969,527.36	66.19%

产品特有风险

（1）持有份额比例较高的投资者（"高比例投资者"）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。

（2）基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。

（3）基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

§9备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安中证医药100指数证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安中证医药100指数证券投资基金基金合同》
3、《国联安中证医药100指数证券投资基金招募说明书》
4、《国联安中证医药100指数证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

9.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日

国联安主题驱动混合型证券投资基金

2017 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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年四月二十二日

§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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安主题驱动混合
基金主代码	257050
交易代码	257050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
报告期末基金份额总额	128,131,094.57份
投资目标	把握中国经济结构转型带来的投资机会，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	1. 资产配置策略 根据宏观经济发展趋势、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。 若出现重大突发事件、投资者情绪急剧变化、海外市场异常变动等因素导致投资决议形成的市场环境发生改变，基金经理可以提出大类资产配置的调整建议，投资决策委员会召开会议，讨论基金经理的建议并确定大类资产的调整比例，由基金经理执行。 2. 股票投资策略 本基金股票投资运用主题驱动投资策略。通过"自上而下"的分析方法，前瞻性地挖掘中国经济结构转型过程中涌现的投资主题，结合价值投资理念，精选投资主题下的个股，获取超额收益率。 投资主题是影响经济发展或企业盈利前景的趋势性因素。投资主题是动态的，一般分为四个阶段：主题雏形阶段、主题形成阶段、主题繁荣阶段、主题衰退阶段。 在主题的雏形阶段，对主题的关注度较低，市场反映往往不足；主题繁荣阶段，主题引起广泛关注，市场反映往往过度。这种反应不足和反应过度就带来股票定价的偏差，即主题雏形阶段，股票往往被低估，而到主题繁荣阶段，股票往往被高估。通过对主题进程的把握，利用这种定价偏差，精选主题下的相关个股，在主题雏形阶段买入，在主题繁荣阶段卖出，形成完整的主题驱动投资策略。 3.债券投资策略 在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金采用久期控制下的债券积极投资策略，满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。主要的债券投资策略有： (1)久期控制策略 (2)类属配置策略 (3)收益率曲线配置策略 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资。 (1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，根据BS模型和溢价率对权证的合理价值做出判断，对价值被低估的权证进行投资； (2)基于对权证标的股票未来走势的预期，充分利用权证的杠杆比率高的特点，对权证进行单边投资； (3)基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资，或利用权证进行风险对冲。
业绩比较基准	沪深300指数×80%＋上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险品种，其预期收益水平和风险低于股票型基金，高于债券型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年1月1日-2017年3月31日）
1.本期已实现收益	-4,318,341.16
2.本期利润	12,052,095.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0879
4.期末基金资产净值	162,052,189.12
5.期末基金份额净值	1.265

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。

3.2 基金净值表现

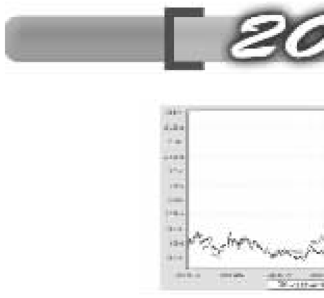
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	7.66%	0.69%	3.58%	0.41%	4.08%	0.28%

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

国联安主题驱动混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年8月26日至2017年3月31日)



注：1、本基金业绩比较基准为沪深300 指数×80%＋上证国债指数×20%；

2、本基金基金合同于2009 年8 月26 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
潘明	本基金基金经理、兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理、国联安科技动力股票型证券投资基金基金经理。	2015-04-28	2017-02-27	8年（自2009年起）	潘明，硕士研究生，1996年6月至1998年6月在计算机科学公司担任咨询师；1998年8月至2005年5月在摩托罗拉公司担任高级行政工程师；2003年1月至2003年12月在扎克斯投资管理公司担任投资分析师；2004年4月至2005年5月在短剑投资公司担任执行董事；2005年5月至2009年7月在指导资本公司担任基金经理兼大宗商品研究总监；2009年8月至2010年3月在海通证券股份有限公司担任投资经理；2010年1月至2013年1月在GCS母基金公司、GCS有限公司、GCS有限责任合伙公司担任独立董事；2010年3月至2012年10月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理助理；2012年10月至2013年12月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理。2013年12月起加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014年2月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理。2015年4月起兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金。2015年4月至2017年2月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金基金经理。2016年1月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金基金经理。
张汉毅	本基金基金经理	2016-12-23	-	6年（自2011年起）	张汉毅，硕士研究生。2009年7月至2011年4月在工业和信息化部电信研究院通信计量中心担任测试工程师。2011年4月至2012年5月在光大证券股份有限公司资产管理总部担任行业研究员。2012年5月至2013年11月在上海光大证券资产管理有限公司担任行业研究员。2013年12月加入国联安基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。2016年12月起任国联安主题驱动混合型证券投资基金基金经理。

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》、《国联安主题驱动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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度板块轮动明显，从年初的大盘蓝筹、周期股的强劲表现，到后面电子、家电等白马股的异军突起，再到季度末新能源板块的归来，总体来看市场对于今年确定性强的高景气品种都较为追捧。本基金在一季度配置方面采取较为均衡的策略，热点板块都进行了一定的布局，取得了相对理想的效果。

在下一阶段，本基金还继续保持以中长期投资和寻求安全边际为基本理念的投资思路，注重估值与增长的结合，在板块配置上继续以均衡策略为主。

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7.66%，同期业绩比较基准收益率为3.58%。

§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	137,718,277.99	84.29
	其中：股票	137,718,277.99	84.29
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	25,488,341.63	15.60
7	其他各项资产	185,292.60	0.11
8	合计	163,391,912.22	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	110,463,955.59	68.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,912.12	0.03
E	建筑业	5,961,741.10	3.68
F	批发和零售业	5,320,756.00	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	3,564,820.00	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	9,862,893.02	6.09
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	16,930.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,482,270.00	1.53
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	137,718,277.99	84.98

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2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的股票。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300156	神雾环保	228,000	7,980,000.00	4.92
2	300526	中潜股份	68,600	7,197,512.00	4.44
3	300145	中金环境	206,500	5,860,470.00	3.62
4	600068	葛洲坝	495,000	5,826,150.00	3.60
5	601398	工商银行	990,000	4,791,600.00	2.96
6	300408	三环集团	241,000	4,774,210.00	2.95
7	300072	三聚环保	73,000	4,567,610.00	2.82
8	002078	太阳纸业	590,000	4,206,700.00	2.60
9	002705	新宝股份	200,000	3,906,000.00	2.41
10	600703	三安光电	233,000	3,725,670.00	2.30

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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，没有相关投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 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，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，以及经核实托管人提供的信息，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。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	77,904.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,147.92
5	应收申购款	103,240.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	185,292.60

5.11.4报告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换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300526	中潜股份	7,197,512.00	4.44	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	144,774,563.72
报告期基金总申购份额	7,275,266.13
减：报告期基金总赎回份额	23,918,735.28
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	128,131,094.57

注：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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安主题驱动股票型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安主题驱动混合型证券投资基金基金合同》
3、《国联安主题驱动混合型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安主题驱动混合型证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

8.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日