

国联安保本混合型证券投资基金

2017年度报告摘要

2017年 12月 31日

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：二〇一八年三月二十七日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员不存在虚假记载、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。

本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金的业绩表现并不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人对报告期内基金运作合规性情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本年度报告摘要摘录了年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告中的财务数据经审计，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，对投资者有重要阅读。

本报告自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

基金名称	国联安保本混合
基金代码	00058
交易代码	00058
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月23日
基金托管人	国联安基金管理有限公司
基金销售机构	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	41,757,701.26份
基金的存续期间	不定期

§ 2.2 基金产品说明

投资目标 在本基金投资组合中控制风险和收益，力争在风险与收益之间取得平衡。

投资策略 本基金通过 CPI(Constant Proportion Portfolio Insurance) 和定期比例调整策略，即定期将部分资产投资于货币市场基金，同时根据市场利率变化定期调整股票资产的配置比例，从而在保证本金安全的前提下，力争在风险与收益之间取得平衡。

基金经理 在本基金的投资决策过程中发挥重要作用。

业绩比较基准 本基金选择沪深 300 指数收益率乘以 60% 加上银行存款利率（税后）乘以 40% 作为本基金的业绩比较基准。

风险收益特征 本基金为保本型基金产品，属于投资组合中的低风险收益品种。

基金管理人及基金托管人

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 中国工商银行股份有限公司
姓名 陈朝霞 陈朝霞
联系电话 021-38920206 010-66105799
电子邮箱 customer@qlj-allianz.com custody@icbc.com.cn
客户服务电话 021-38747694 0407000365
传真 021-50151928 010-66105798

2.4 信息披露方式

基金管理人通过互联网网站披露信息

网址 http://www.gjz-allianz.com

基金年度报告备置地点 中国上海自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 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 利润和收入

本期净利息收入 647,670.30 854,487.45 20,080,98.16

本期利息收入 482,087.89 -6,767,346.08 18,129,220.56

已实现基金利润 0.0099 -0.1014 0.1966

未实现基金利润增加率 0.98% -7.25% 16.99%

3.1.2 利润和亏损

2017年末 2016年末 2015年末

期初可供分配利润余额 0.1481 0.1382 0.2447

期末可供分配利润余额 41,826,301.52 56,241,692.87 99,092,016.1

期初现金分红比例 0.0017 0.992 1.253

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，计算公式详见本节“利润分配”；3.对期初可供分配利润，采用期末资产负债表中分派利润与未分配利润中实现部分的孰低数。

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 现时点净值增长 份额净值增长 现时点净值增长 (%) (%) (%) (%)

过去三个月 0.26% 0.03% 0.83% 0.01% -0.57% 0.02%

过去六个月 0.67% 0.03% 1.66% 0.01% -0.99% 0.02%

过去一年 0.98% 0.03% 3.30% 0.01% -2.32% 0.04%

过去三年 9.57% 0.28% 11.41% 0.01% -1.84% 0.27%

自基金合同生效以来 17.39% 0.29% 20.04% 0.01% -2.69% 0.28%

注：1.本基金业绩比较基准为后三年定期存款利率×1.2，在本基金成立当年，上述三年定期存款利率“指基金合同”规定当日本人民币银行存款执行的三年定期存款利率，其后的每个自然年，“三年定期存款利率”指当第一个工作日在中华人民共和国银行公布并执行的三年定期存款利率；2.上述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算费用后实际净值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净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安保本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历史走势图对比图

(2013年4月23日至2017年12月31日)



注：1.基金合同生效当年按实际存续期间计算的净值增长率；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，计入费用后实际净值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份基金份额分红金额 现金形式分红金额 再投形式分红金额 年度利润分配合计 备注

2017 - - - -

2016 - - - -

2015 - - - -

合计 - - - -

4.4 管理人对报告期内基金估值方法的说明

4.4.1 报告期内基金估值策略和分析

4.4.2 报告期内基金的估值方法

4.4.3 对期初可供分配利润，采用期末资产负债表中分派利润与未分配利润中实现部分的孰低数。

4.4.4 报告期内基金的利润分配情况

4.4.5 管理人对报告期基金的估值政策和方法的说明

4.4.6 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.7 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.8 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.9 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.10 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.11 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.12 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.13 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.14 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.15 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.16 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.17 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.18 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.19 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.20 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.21 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.22 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.23 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.24 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.25 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.26 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.27 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.28 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.29 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.30 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.31 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.32 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.33 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.34 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.35 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.36 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.37 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.38 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.39 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.40 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.41 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.42 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.43 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.44 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.45 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.46 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.47 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.48 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.49 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.50 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.51 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.52 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.53 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.54 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.55 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.56 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.57 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.58 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.59 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.60 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.61 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.62 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.63 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.64 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.65 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.66 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.67 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.68 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.69 对报告期基金的估值方法的说明

4.4.70 对报告期基金的估值方法的说明

4.