国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年三月二十七日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 3 月 23 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 2017 年 1 月 1 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	国联安鑫安灵活配置混合
基金主代码	001007
交易代码	001007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 1 月 26 日
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
报告期末基金份额总额	133, 146, 796.92 份
基金合同存续期	不定期

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。
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	本基金属于主动式混合型证券投资基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金,通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	田青
	联系电话	021- 38992806	010- 67595096
	电子邮箱	customer.service@gtja- allianz.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021- 38784766/ 4007000365	010- 67595096
传真		021- 50151582	010- 66275853

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	www.gtja- 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 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年1 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	54, 193, 592.52	74, 007, 144.83	292, 946, 240.97
本期利润	43, 550, 625.49	22, 180, 647.77	363, 349, 160.57
加权平均基金份额本期利润	0.1031	0.0226	0.0958
本期基金份额净值增长率	11.15%	3.35%	9.42%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0791	0.0785	0.0241
期末基金资产净值	143, 682, 289.81	693, 230, 557.72	2, 119, 285, 059.26
期末基金份额净值	1.0791	1.079	1.044

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。

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	2.68%	0.78%	2.60%	0.40%	0.08%	0.38%
过去六个月	6.89%	0.55%	5.07%	0.35%	1.82%	0.20%
过去一年	11.15%	0.41%	10.86%	0.32%	0.29%	0.09%
自基金合同生效起至今	25.70%	0.26%	14.10%	0.83%	11.60%	- 0.57%

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

国联安鑫安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 1 月 26 日至 2017 年 12 月 31 日)

注:1.本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数× 50%+上证国债指数× 50%;

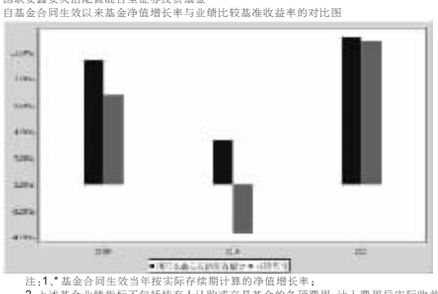
2.本基金基金合同于 2015 年 1 月 26 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

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。

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

国联安鑫安灵活配置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对比图



注:1.* 基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率;

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

单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	1.150	15, 492, 098.04	30, 694, 285.95	46, 186, 383.99	-
2016	-	-	-	-	-
2015	0.500	91, 664, 936.98	10, 210, 161.52	101, 875, 098.50	-
合计	1.650	107, 157, 035.02	40, 904, 447.47	148, 061, 482.49	-

注:本基金基金合同于 2015 年 1 月 26 日生效。

§ 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,公司共管理四十只开放式基金。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		
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)、国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫富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、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫耀灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安稳保本混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈混合型证券投资基金基金经理、国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2015- 03- 30	2017- 01- 19	16年(自 2001 年起)	冯俊先生,复旦大学经济学博士。曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管,光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员、长盛基金管理有限公司基金经理助理,泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理,2008 年 10 月起加入国联安基金管理有限公司,现任债券组合管理部总监,2009 年 3 月至 2015 年 3 月任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2010 年 6 月至 2013 年 7 月兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理,2011 年 1 月至 2012 年 7 月兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理,2013 年 7 月至 2017 年 1 月任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2014 年 12 月至 2016 年 6 月兼任国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月至 2017 年 1 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。2015 年 3 月至 2017 年 1 月兼任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月至 2017 年 1 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 5 月至 2017 年 1 月兼任国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月至 2017 年 1 月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 11 月至 2017 年 1 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、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理。2016 年 2 月至 2017 年 1 月兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金、国联安鑫耀灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 3 月至 2017 年 1 月兼任国联安稳保本混合型证券投资基金基金经理。2016 年 9 月至 2017 年 1 月兼任国联安鑫盈混合型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月至 2017 年 1 月担任国联安睿智定期开放混合型证券投资基金基金经理。
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、国联安信心增长债券型证券投资基金的基金经理、国联安锐意成长混合型证券投资基金基金经理。	2016- 02- 26	-	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。
薛琳	本基金基金经理助理	2015- 01- 22	-	11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》、《国联安鑫安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。风险管理部对银行间、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

2017 年全年,上证指数收涨,而波动率却是历史上最低。全年市场基本处于横盘小幅震荡状态。指数波澜不惊,但是板块行情分化较大。全年来看,家电和白酒的行情贯穿全年,年中以新能源为代表的周期板块表现抢眼。

基金管理人的操作风格主要以稳健为主。2017 年最后 1 个月,配置方向主要以稳健的大金融,医药为主,本基金净值取得了较好的收获。

基金管理人全年坚守了稳扎稳打的操作风格和绝对收益的理念,整体配置会以大消费,大金融的优质个股为主。未来基金管理人会继续坚持下去,深入研究各个行业的景气度,配置景气行业的优势个股,力争为投资人创造稳健且可观的回报。

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 11.15%,同期业绩比较基准收益率为 10.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年,宏观经济继续以稳健为主,货币政策稳中偏紧,金融去杠杆会持续深入,通胀可能会有所抬头。基于此,基金管理人认为 2018 年指数上涨空间可能不大,整体以横盘休整为主。但是结构性机会依然会有所体现。全年操作以波段为主,攻守兼备。看好有强大研发实力的医药龙头公司,同时看好大金融中有龙头优势的大行和增长迅速的股份制银行,继续坚守景气行业的投资逻辑。

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运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、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,量化投资部、研究部、权益投资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,本基金对本报告期内利润分配情况如下,符合本基金基金合同的相关规定。

本基金以截止至 2017 年 7 月 19 日的可供分配利润为基准,于 2017 年 7 月 31 日实施分红,向截止至 2017 年 7 月 28 日在本基金注册登记入国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人,按每 10 份基金份额 0.640 元派发红利。共发放红利 25,539,722.65 元。本基金以截止至 2017 年 9 月 30 日的可供分配利润为基准,于 2017 年 10 月 23 日实施分红,向截止至 2017 年 10 月 20 日在本基金注册登记入国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人,按每 10 份基金份额 0.510 元派发红利。共发放红利 20,646,661.34 元。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 46,186,383.99 元。

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

本托管人复核审查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。

§ 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,注册会计师王国蓉、张楠签字出具了毕马威华振审字第 1800175 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:国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 2016年 12 月 31 日
资产:	-	-
银行存款	1, 466, 785.79	57, 630, 441.97
结算备付金	292, 809.45	2, 730, 111.98
存出保证金	17, 834.49	44, 573.03
交易性金融资产	142, 251, 329.11	624, 820, 386.66
其中:股票投资	124, 044, 711.61	82, 441, 788.66
基金投资	-	-
债券投资	18, 206, 617.50	542, 378, 598.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	567, 225.86	9, 764, 696.14
应收股利	-	-
应收申购款	3, 501.49	13, 474.57
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	144, 599, 486.19	695, 003, 684.35
负债和所有者权益	本期末 2017年 12 月 31 日	上年度末 2016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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	100, 673.36	315, 291.71
应付管理人报酬	186, 252.17	889, 657.59
应付托管费	31, 042.02	148, 276.27
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	203, 063.25	18, 031.72
应交税费	21, 157.04	21, 157.04
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	375, 008.54	380, 712.30
负债合计	917, 196.38	1, 773, 126.63
所有者权益:	-	-
实收基金	133, 146, 796.92	642, 771, 269.40
未分配利润	10, 535, 492.89	50, 459, 288.32
所有者权益合计	143, 682, 289.81	693, 230, 557.72
负债和所有者权益总计	144, 599, 486.19	695, 003, 684.35

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.0791 元,基金份额总额 133,146,796.92 份。

7.2 利润表

会计主体:国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一.收入	52, 831, 035.80	42, 082, 014.79
1.利息收入	13, 921, 567.25	34, 044, 056.71
其中:存款利息收入	415, 445.33	709, 006.30
债券利息收入	12, 507, 046.77	32, 686, 051.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	999, 075.15	648, 998.73
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	49, 364, 941.40	57, 714, 142.48
其中:股票投资收益	50, 787, 179.20	53, 876, 654.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	- 2, 661, 729.68	3, 496, 239.67
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	1, 239, 491.88	341, 248.02
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	- 10, 642, 967.03	- 51, 826, 497.06
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	187, 494.18	2, 150, 312.66
减:二.费用	9, 280, 410.31	19, 901, 367.02
1.管理人报酬	6, 982, 494.96	15, 660, 291.81
2.托管费	1, 163, 749.12	2, 610, 048.59
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	554, 752.52	543, 837.89
5.利息支出	158, 528.12	644, 792.81
其中:卖出回购金融资产支出	158, 528.12	644, 792.81
6.其他费用	420, 885.59	442, 395.92
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)	43, 550, 625.49	22, 180, 647.77
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)	43, 550, 625.49	22, 180, 647.77

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 1 日至 2017 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)	642, 771, 269.40	50, 459, 288.32	693, 230, 557.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43, 550, 625.49	43, 550, 625.49
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)	- 509, 624, 472.48	- 37, 288, 036.93	- 546, 912, 509.41
其中:1.基金申购款	33, 446, 763.26	2, 175, 118.43	35, 621, 881.69
2.基金赎回款	- 543, 071, 235.74	- 39, 463, 155.36	- 582, 534, 391.10
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)	-	- 46, 186, 383.99	- 46, 186, 383.99
五.期末所有者权益(基金净值)	133, 146, 796.92	10, 535, 492.89	143, 682, 289.81
项目	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 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)	2, 030, 052, 314.56	89, 232, 744.70	2, 119, 285, 059.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22, 180, 647.77	22, 180, 647.77
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)	- 1, 387, 281, 045.16	- 60, 954, 104.15	- 1, 448, 235, 149.31
其中:1.基金申购款	7, 140, 102.66	459, 480.93	7, 599, 583.59
2.基金赎回款	- 1, 394, 421, 147.82	- 61, 413, 585.08	- 1, 455, 834, 732.90
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)	642, 771, 269.40	50, 459, 288.32	693, 230, 557.72

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:孟朝霞,主管会计工作负责人:李桐,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

国联安鑫安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”)(关于核准国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金募集的批复)(证监基金字[2014]755 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《国联安鑫安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 1 月 26 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 2,411,418,386.29 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国联安鑫安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(含中小企业私募债)、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、证券投资基金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、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的 0%-95%;债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类资产占基金资产的 5%-100%。其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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《国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金提高基金份额净值精度并修改基金合同及托管协议的公告》,自 2017 年 7 月 24 日起,本基金的基金份额净值精度由保留到小数点后第 3 位(0.001 元)提高至保留到小数点后第 4 位(0.0001 元),

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。

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及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况,2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内及上年度可比期间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 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安	233, 537, 492.61	78.12%	218, 161, 666.92	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 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	-	-	12, 162, 500, 000.00	99.15%

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 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	1, 140.50	0.34%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 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	305, 960.79	100.00%	16, 681.72	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 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
当期发生的基金应支付的管理费	6, 982, 494.96		15, 660, 291.81	
其中:支付销售机构的客户维护费	1, 318, 926.31		2, 603, 584.49	

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 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费 = 前一日基金资产净值× 1.5%/ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1, 163, 749.12	2, 610, 048.59

注:支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值× 0.25%/ 当年天数。

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本报告期内及上年度可比期间,基金管理人均未投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	1, 466, 785.79	387, 679.07	57, 630, 441.97	604, 997.56

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计算。

本基金通过“建设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 2017 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 292,809.45 元(2016 年 12 月 31 日:人民币 2,730,111.98 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

本报告期内及上年度可比期间,本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间,本基金均无其他关联交易事项