国联安鑫禧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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	国联安鑫禧混合
基金主代码	002365
交易代码	002365
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,568,025.72份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	国联安鑫禧混合A / 国联安鑫禧混合C
下属分级基金的交易代码	002365 / 002366
报告期末下属分级基金的份额总额	145,454,109.87份 / 16,113,915.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资债务融券、金融资产、管理规避的品种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,政策演进来,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,对投资、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。在在规定制度及风险控制指标下,形成大类资产的配置方案。 在投资投资上,本基金将重点关注共有以下一项或者多项特征的债券: 1)信用等级高、流动性好。 2)变现风险好,未来信用评级有不稳定或者明显改善的企业发行的债券; 3)在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下,运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后,市场交易价格被低估的债券。 4)公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理,有一定下行保护的可转换债券。
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	较高预期风险,较高预期收益

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆菁云	朱萍
	联系电话	021-38982806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784769/400700365	95528
传真		021-50151582	021-63602540

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	http://www.gtja-allianz.com
基金年度报告备置地点	中国 上海1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2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	国联安鑫禧混合A	国联安鑫禧混合C	国联安鑫禧混合A	国联安鑫禧混合C
本期已实现收益	39,323,960.86	2,068,040.46	25,148,576.46	3,351,392.91
本期利润	38,381,327.65	798,916.00	17,150,813.45	1,142,552.11
加权平均基金份额本期利润	0.0589	0.0210	0.0228	0.0088
本期基金份额净值增长率	0.91%	0.57%	2.40%	1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末	
	国联安鑫禧混合A	国联安鑫禧混合C	国联安鑫禧混合A	国联安鑫禧混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0053	0.0088	0.0237	0.0183
期末基金资产净值	146,229,541.71	16,255,675.32	868,509,944.98	78,156,347.34
期末基金份额净值	1.0053	1.0088	1.024	1.018

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;

4、本基金基金合同于2016年2月3日生效。上年度可比期间为2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日。

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

1、国联安鑫禧混合A:

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	-5.46%	0.72%	2.80%	0.40%	-8.06%	0.32%
过去六个月	-2.88%	0.51%	5.07%	0.35%	-7.95%	0.16%
过去一年	0.91%	0.37%	10.86%	0.32%	-9.95%	0.05%
过去三年	-	-	-	-	0.00%	0.00%
过去五年	-	-	-	-	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.33%	0.27%	19.26%	0.43%	-15.93%	-0.16%

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、国联安鑫禧混合C:

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	-5.48%	0.72%	2.80%	0.40%	-8.08%	0.32%
过去六个月	-3.05%	0.50%	5.07%	0.35%	-8.12%	0.15%
过去一年	0.57%	0.37%	10.86%	0.32%	-10.29%	0.05%
过去三年	-	-	-	-	0.00%	0.00%
过去五年	-	-	-	-	0.00%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.38%	0.27%	19.26%	0.43%	-16.88%	-0.16%

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。

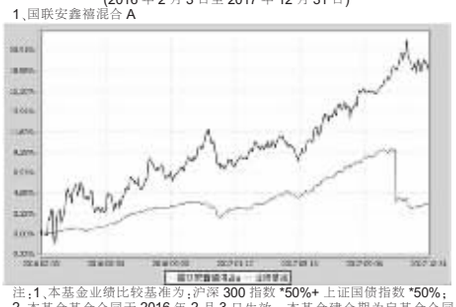
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安鑫禧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

(2016年2月3日至2017年12月31日)

1、国联安鑫禧混合A



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。

2、国联安鑫禧混合C

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

1、国联安鑫禧混合A:

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	0.280	6,686,489.11	37.12	6,686,526.23	-
2016	-	-	-	-	-
合计	0.280	6,686,489.11	37.12	6,686,526.23	-

注:此次分红的收益分配基准日为2017年12月4日,即实施的是2017年度的利润分配。本基金基金合同于2016年2月3日生效,截至报告期末,本基金成立未满2年。

2、国联安鑫禧混合C:

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	0.150	253,715.64	2,638.92	256,354.56	-
2016	-	-	-	-	-
合计	0.150	253,715.64	2,638.92	256,354.56	-

注:此次分红的收益分配基准日为2017年12月4日,即实施的是2017年度的利润分配。本基金基金合同于2016年2月3日生效,截至报告期末,本基金成立未满2年。

§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、兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理、国联安鑫盈安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫安混灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安混灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈增利债券证券投资基金基金经理、国联安鑫盈利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈利三年定期开放债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈稳利债券证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心回报债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈稳健增利债券证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心收益债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心回报三年定期开放债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心回报一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心回报债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心回报一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盈安心回报三