国联安鑫盛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	国联安鑫盛混合	
基金主代码	003772	
交易代码	003772	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月30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	200,167,667.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安鑫盛混合A	国联安鑫盛混合C
下属分级基金的交易代码	003772	003773
报告期末下属分级基金的份额总额	200,167,667.06份	2,451.87份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险和保持基金资产良好流动性的基础上,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资策略	1.资产配置策略 本基金是混合型基金,根据宏观经济发展趋势、政策取向、金融环境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。 2.债券投资策略 (1)久期配置:基于宏观经济数据、政策导向、利率趋势、通货膨胀预期、市场情绪等因素的变化,来预测利率变动的方向和趋势,根据不同大类资产在宏观经济周期的演变,跟踪宏观经济周期的演变,分析各种经济周期的特点,确定债券资产配置的基本方向和特征,结合市场效果、财政政策以及债券市场资金供求分析,为各种投资收益来金融工具进行风险评估,最终确定投资组合的久期配置。 (2)期限结构配置:基于数量化模型,自上而下的资产配置。 在确定组合久期后,通过研究收益率曲线形态,采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估,对收益率曲线各个期限段策略收益进行分析,通过比较资产配置模型选择期限收益率最高的期限段进行配比组合,从而在子弹型、杠铃型合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。 子弹型:期使组合的现金流尽量集中分布; 杠铃型:期使组合的现金流尽量平均分布; 梯形型:期使组合的现金流在投资期内尽可能均匀分布。 (3)债券类别配置(个券选择):主要依据信用利差分析,自上而下的资产配置。 本基金根据利率债券和信用债券之间的相对收益,以利差定价债券收益的分析为依据,同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析,综合分析各个品种的信用利差变化,在信用利差水平较高时持有信用债券,会选债、短期融资券、可分离可转债等信用债券,在信用利差水平较低时持有国债等利率债券,从而通过整个债券组合中各类别债券投资比例,个券选择:基于个券投资品种具体情况,自下而上的资产配置。 个券选择还遵循如下原则: 相对价值原则,选择风险价值相对较高的品种,同等收益率风险较低的品种。 绝对价值原则,选择具有绝对价值的品种。 3.股票投资策略 在股票投资中,本基金采用定量分析与定性分析相结合的方法,选择其中具有较高成长潜力,在行业中具备核心优势,股价具有较高安全边际的优质上市公司进行投资。同时,本基金也将积极关注上市公司基本面发生改变时所带来的投资交易机会。 (1)定量分析 本基金将对以财上市公司质量和增长潜力的成长性指标,财务指标和估值指标等进行定量分析,以挑选具有成长优势、财务状况较为稳定的个股。 本基金考察的成长指标主要包括:主营收入增长率、净利润增长率。 本基金考察的财务指标主要包括:净资产收益率、资产负债率。 本基金考察的估值指标主要包括:市盈率、市盈率/净利润增长率。 (2)定性分析 本基金主要通过宏观经济等方法,综合考察评估公司的经营情况,重点投资具有较高成长潜力,在行业中具备核心优势,股价具有较高安全边际的优质上市公司。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%
风险收益特征	中等预期风险,中等预期收益

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	陆康芯	朱萍
	联系电话	021-38962806	021-61618888
	电子邮箱	cs@lonsen.com.cn	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	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	www.gtja-allianz.com
基金年度报告备置地点	中国上海(自贸区试验区陆家嘴环路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11月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	国联安鑫盛混合A	国联安鑫盛混合C	国联安鑫盛混合A	国联安鑫盛混合C
本期已实现收益	24,871,221.28	93.80	544,824.73	11.27
本期利润	27,351,253.16	73.82	-2,313,640.09	-15.47
加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.0275	-0.0054	-0.00033
本期基金份额净值增长率	3.41%	3.08%	-0.45%	-0.35%
3.1.2期末数据和指标	2017年末		2016年末	
	国联安鑫盛混合A	国联安鑫盛混合C	国联安鑫盛混合A	国联安鑫盛混合C
期末可供分配基金份额利润	0.0015	0.0122	-0.0045	-0.0035
期末基金资产净值	200,462,010.47	2,481.77	647,700,399.67	4,125.68
期末基金份额净值	1.0015	1.0122	0.9955	0.9965

注:1.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;

2.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;

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

1.国联安鑫盛混合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	-1.28%	0.13%	1.10%	0.16%	-2.38%	-0.03%
过去六个月	0.25%	0.10%	2.18%	0.14%	-1.93%	-0.04%
过去一年	3.41%	0.09%	4.66%	0.13%	-1.25%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.95%	0.09%	2.73%	0.14%	0.22%	-0.05%

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.国联安鑫盛混合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	-1.40%	0.13%	1.10%	0.16%	-2.50%	-0.03%
过去六个月	0.12%	0.10%	2.18%	0.14%	-2.06%	-0.04%
过去一年	3.08%	0.09%	4.66%	0.13%	-1.58%	-0.04%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.72%	0.09%	2.73%	0.14%	-0.01%	-0.05%

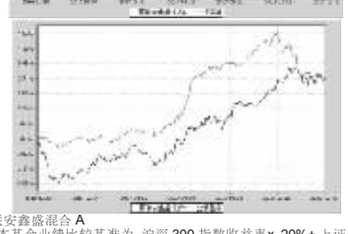
注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国联安鑫盛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11月30日至2017年12月31日)



1.国联安鑫盛混合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.国联安鑫盛混合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.国联安鑫盛混合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	22,424,095.33	-	22,424,095.33	-
2016	-	-	-	-	-
合计	0.280	22,424,095.33	-	22,424,095.33	-

注:1.2017年度利润分配的收益基准日为2017年12月4日;

2.本基金合同于2016年11月30日生效。

2.国联安鑫盛混合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	35.23	1.65	36.88	-
2016	-	-	-	-	-
合计	0.150	35.23	1.65	36.88	-

注:1.2017年度利润分配的收益基准日为2017年12月4日;

2.本基金合同于2016年11月30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。国联安基金管理有限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		
侯慧娟	本基金基金经理,兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理,国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安睿享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理	2016-11-30	-	10年	自2007年1月起任国联安基金研究员,2008年7月至2008年10月在经济部时代(上海)有限公司从事债券分析,2009年12月至2012年9月在国信证券股份有限公司经济研究所从事债券期限结构研究,2012年9月至2015年6月在德邦基金管理有限公司固定收益部从事研究和管理工作,期间曾担任基金经理和固定收益部副总监。2015年6月加入国联安基金管理有限公司,2015年12月起任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安货币市场证券投资基金基金经理,2016年3月起兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年12月起兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理,2016年12月至2017年9月兼任国联安睿利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年12月起兼任国联安睿利定期开放混合型证券投资基金基金经理。
杨子江	本基金基金经理,兼任国联安稳健双心灵活配置混合型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,国联安鑫汇混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫裕混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫隆混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫利混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫怡混合型证券投资基金基金经理	2017-12-29	-	16年	杨子江,2001年5月至2008年3月在上海泰信投资管理有限公司担任研究员,2008年4月加入国联安基金管理有限公司,历任高级研究员、研究部副总监,现任研究部总监。2017年12月29日起任国联安鑫盛混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫汇混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫裕混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫利混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫怡混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫隆混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2017年12月29日起任国联安鑫怡灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
林涛	本基金基金经理助理,兼任研究部行业研究员	2016-12-01	-	6年	自2011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》、《国联安鑫盛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年全年来看,国内宏观经济基本韧性较强,整体好于市场一致预期。PMI数据虽然有所回落但一直维持在荣枯线之上。PPI数据由于环保限产影响,虽然4季度有所回落,回落幅度低于预期。CPI一直维持在2%以下。央行货币政策稳健中性,双支柱特征明显,公开市场更加注重运用"削峰填谷"操作,平滑关键时间节点的流动性。M2同比增速自2017年5月份以来一直低于10%,金融去杠杆效果明显。海外方面,欧洲经济继续复苏,欧央行预计将逐步退出量化宽松,但预期仍不明确;美国经济温和复苏,美联储如期加息三次,但对汇率和外汇占款流出影响不大。

债券市场方面,由于经济基本面整体好于预期,货币政策及金融监管稳健中性,但由于金融去杠杆政策基调贯穿全年,整个银行体系负债压力较大,交易盘情绪脆弱,配置盘无力,二季度和四季度债市调整幅度较大,加上12月份银行年底MPA考核导致的12月下旬资金紧张,债券市场整个4季度各期限和评级收益率大幅上行。十年期国开债活跃券上行幅度约50bp,信用债各等级期限收益率平均上行幅度约50bp,全年来看利率债和信用债各期限等级平均上行幅度约100bp,全年熊市特征明显。货币市场方面,由于季末MPA考核及银行体系负债压力较大,同业存单发行利率4季度上行幅度较大,创2015年以来新高,3个月AAA股份制银行存单利率一度上行至5.4%。

本基金在2017年保持稳健谨慎操作,适当参与股票一级市场打新获取确定性收益,随着市场调整降低了组合杠杆和久期,保持基金流动性的同时为投资者获取了稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安鑫盛混合A的份额净值增长率为3.41%,同期业绩比较基准收益率为4.66%;国联安鑫盛混合C的份额净值增长率为3.08%,同期业绩比较基准收益率为4.66%。

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,经济基本面总体呈边际回落趋势,PPI惯性向下特征明显,通胀虽有压力但由于货币条件较紧,预计整体压力不大。货币政策更加注重双支柱特征,预计将在上半年金融监管和资管细则落地后偏向于关注经济基本面。货币市场利率预计仍然会呈现季节性时点冲高特征,货币政策"削峰填谷"操作预计仍会继续。今年对银行表内流动性监管的新规和资管细则的出台预计会引发融资收紧,中低评级的信用债利差预计大幅走阔,但利率债和高等级信用债将成为高负债压力下的核心资产。本基金在2018年将继续保持稳健谨慎操作,适当参与股票一级市场打新获取确定性收益,同时配置短久期高评级存单和短融,保持基金流动性的同时争取为投资者获取稳健的回报。

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12月4日的可供分配利润为基准,于2017年12月15日实施分红,向截止至2017年12月14日在本基金注册登记人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0.28元(A类),每10份基金份额0.15元(C类)派发红利。共发放红利22,424,132.21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

2017年2月13日-2017年8月7日,2017年10月9日-2017年11月29日本基金份额持有人数量不满二百人。

基金管理人拟展开持续营销活动提升基金总户数。

§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

本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"本托管人")在对国联安鑫盛混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,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

本报告期内,本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定,对国联安鑫盛混合型证券投资基金的投资运作进行了监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配,分配金额为22,424,132.21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

本报告期内,由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告)在的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内),投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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1800185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:国联安鑫盛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	5,315,980.56	107,363,040.20
结算备付金	1,297,414.39	-
存出保证金	108,813.64	-
交易性金融资产	190,852,500.00	300,991,000.00
其中:股票投资	9,838,500.00	30,514,000.00
基金投资	-	-
债券投资	176,721,000.00	270,477,000.00
资产支持证券投资	4,293,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	237,500,476.25
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,801,377.04	2,171,359.94
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	201,376,085.63	648,025,876.39
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	325,230.86	219,235.90
应付管理费	54,205.11	36,539.29
应付销售服务费	0.93	1.69
应付交易费用	222,156.49	37,505.78
交易性金融负债	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	310,000.00	28,048.67
负债合计	911,593.39	321,351.04
所有者权益:	-	-
实收基金	200,170,118.93	650,639,949.12
未分配利润	294,373.31	-2,935,423.77
所有者权益合计	200,464,492.24	647,704,525.35
负债和所有者权益总计	201,376,085.63	648,025,876.39

注:报告截止日2017年12月31日,国联安鑫盛混合A基金份额净值1.0015元,国联安鑫盛混合C基金份额净值1.0122元。基金份额总额200,170,118.93份,其中国联安鑫盛混合A基金份额总额200,167,667.06份,国联安鑫盛混合C基金份额总额2,451.87份。

7.2 利润表

会计主体:国联安鑫盛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11月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一、收入	41,423,225.50	-1,983,622.35
1.利息收入	34,695,538.09	1,026,779.88
其中:存款利息收入	689,276.44	498,809.20
债券利息收入	32,610,352.52	194,790.75
资产支持证券利息收入	521,971.31	-
买入返售金融资产收入	673,937.82	333,176.93
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,241,661.11	-1,551,916.67
其中:股票投资收益	17,797,964.46	-151,916.67
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-16,278,567.10	-
资产支持证券投资收益	-10,921.31	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,733,185.06	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,480,011.92	-2,858,491.56
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,014.38	6.00
减:二、费用	14,071,898.52	330,033.21
1.管理人报酬	4,690,525.83	219,235.90
2.托管费	781,754.23	36,539.29
3.销售服务费	11.11	1.69
4.交易费用	670,662.23	44,167.86
5.利息支出	7,593,107.84	-
其中:卖出回购金融资产支出	7,593,107.84	-
6.其他费用	335,837.28	30,088.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	27,351,326.98	-2,313,655.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	27,351,326.98	-2,313,655.56

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安鑫盛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)	650,639,949.12	-2,935,423.77	647,704,525.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,351,326.98	27,351,326.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净减少以"-"号填列)	-450,469,830.19	-1,697,397.69	-452,167,227.88
其中:1.基金申购款	150,228,121.86	-225,171.61	150,002,950.25
2.基金赎回款	-600,697,952.05	-1,472,226.08	-602,170,178.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净减少以"-"号填列)	-	-22,424,132.21	-22,424,132.21
五、期末所有者权益(基金净值)	200,170,118.93	294,373.31	200,464,492.24
项目	上年度可比期间 2016年11月30日(基金合同生效日)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)	200,022,429.91	-	200,022,429.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,313,655.56	-2,313,655.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净减少以"-"号填列)	450,617,519.21	-621,768.21	449,995,751.00
其中:1.基金申购款	450,618,769.26	-621,769.26	449,997,000.00
2.基金赎回款	-1,250.05	1.05	-1,249.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	650,639,949.12	-2,935,423.77	647,704,525.35

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:李柯,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

国联安鑫盛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")《关于准予国联安鑫盛混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2568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《国联安鑫盛混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2016年11月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为200,022,429.91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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金于2016年11月22日至2016年11月23日募集,募集期间净认购资金人民币200,004,429.76元,认购资金在募集期间产生的利息人民币18,000.15元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,022,429.91份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1600894号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安鑫盛混合型证券投资基金基金合同》和《国联安鑫盛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(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、可转换债券)、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单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,本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的0-25%,债券投资占基金资产的比例不低于75%,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×20%+上证国债指数收益率×80%。

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2016年12月31日及2017年12月31日的财务状况、自2016年11月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日及自2017年1月1日至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2016年11月30日(基金合同生效日)至2016年12月31日及自2017年1月1日至2017年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时,本基金终止确认该金融资产:

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

- 该金融资产已转移,且本基金将金融资产