国联安锐意成长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:中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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 23 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	国联安锐意成长混合
基金主代码	004076
交易代码	004076
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年 1 月 23 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	249,474,833.33 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选具有较高成长性及盈利能力上市公司,在严格控制投资风险的条件下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
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。 (2) 股票投资策略 本基金主要以定量和定性两个方面对上市公司进行分析。 1) 定量分析 本基金从原料账户、原系成本、增长能力以及股价的价值水平等方面对上市公司进行定量分析。 首先,通过 ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的资利能力,通过 WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本,将公司的资利能力和资本成本指标相结合,选择出创造价值的公司。 其次,对公司的成长能力和价值指标以及财务指标进行分析: 成长指标主要包括:主营业务收入增长率、净利润增长率; 价值指标主要包括:市盈率、市盈率/净利增长率; 财务指标主要包括:净资产收益率、资产负债率。 本基金将重点关注公司的主营业务收入增长率、净利润增长率等成长性指标。 主营业务收入增长率是把握公司成长性的主要指标。本基金将密务整理主营业务收入增长率的基础上,结合分析公司的产能扩张、主导产品的市场供求变化趋势、行业竞争格局以及产品的差异性或替代性等因素,参考上市公司的市盈率倍率,比较股权投资回报率指标,准确把握预期主营业务收入增长的前提和可信性。 主营业务利润率是企业一定时期主营业务利润同主营业务收入净额的比率。它表明企业每单位主营业务收入所产生的主营业务利润,反映了企业主营业务的获利能力。公司主营业务突出,同主营业务利润率较高,表明其在竞争中占据优势地位。 (2) 定性分析 本基金将把握中长期中国经济结构调整的方向,通过对宏观经济运行趋势、产业环境、产业政策和行业竞争格局等因素的分析,确定宏观天时全局优势复杂对不同行业的潜在影响,判断各行业的相对投资价值与投资时机。本基金从经济周期因素、行业政策因素和行业基本面、包括行业生命周期、行业发展趋势和发展空间、行业内竞争态势、行业收入及利润增长情况等)三个方面评估行业的成长性。 本基金进一步以投资主题、资源优势和商业模式等方面,把握公司的成长性。 (3) 普通债券投资策略 在债券投资上,本基金将重点关注具有以下一项或多项特征的债券: 1) 信用等级高、流动性好; 2) 特别是收益率、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券; 3) 由宏观面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,市场交易的相对价值低估的债券。 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债。 (4) 中小企业私募债券投资策略 中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构偏于普通上市公司,信息披露规模对等程度,对企业财务状况、经营能力的评估难度高于普通上市公司,主要风险可行又限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资重点关注信用风险和流动性风险。 本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资。中小企业私募债券,并通过组合管理,分散信用、流动性风险,力争提高组合的收益水平。采用投资组合的最大化,本基金将采取信用评级高于投资级别的债券品种,以期通过信用评级的提升带来的资本利得收益。 信用评级等分析,是衡量债券以为公司投资时期内的发展趋势较好的利润来源,对于具有特许权、专有技术、品牌等独特资源或者矿产、旅游等自然资源的公司,本基金将主要通过对公司的行业影响、进入壁垒、政策扶持力度等方面的分析,判断公司的资源优势是否发挥持续优势。 国内金模式分析,公司的商业模式决定了其在行业中的地位和发展潜力,独特的商业模式将支持公司的快速发展。本基金将从商业模式的独特性、可复制性、可持续性及资利性等角度等多公司的商业模式是否符合行业发展的趋势,是否可以维持公司销售规模和盈利的持续增长。 (5) 股指期货投资策略 在股指投资上,本基金将重点关注具有以下一项或多项特征的债券: 1) 信用等级高、流动性好; 2) 特别是收益率、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券; 3) 由宏观面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,市场交易的相对价值低估的债券。 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债。 (4) 中小企业私募债券投资策略 中小企业私募债券本质上为公司债,只是发行主体扩展到未上市的中小型企业,扩大了基金进行债券投资的范围。由于中小企业私募债券发行主体为非上市中小企业,企业管理体制和治理结构偏于普通上市公司,信息披露规模对等程度,对企业财务状况、经营能力的评估难度高于普通上市公司,主要风险可行又限制了合格投资者的数量,会导致一定的流动性风险。因此本基金中小企业私募债券的投资重点关注信用风险和流动性风险。 本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资。中小企业私募债券,并通过组合管理,分散信用、流动性风险,力争提高组合的收益水平。采用投资组合的最大化,本基金将采取信用评级高于投资级别的债券品种,以期通过信用评级的提升带来的资本利得收益。内部信用评级是深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行内部信用评级,以便确定相对合理的中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。 本基金根据内部的信用分析方法对可选的中小企业私募债券品种进行筛选过滤,重点分析发行主体的公司资产、竞争地位、治理结构、盈利能力、偿债能力、现金流及不可预测事件因素,为个不同因素不同权重,采用数量化方法对主体和发行债券进行打分和风险价值评估,选择发行主体资质较良、信息合理且流通相对充分的品种进行适度投资。 (5) 股指期货投资策略 在股指期货投资上,本基金以套期保值和有效管理为目标,在控制风险的前提下,谨慎适当参与股指期货的投资,本基金在进行股指期货投资中,综合研究股指期货的收益性、流动性及风险特征,主要选择流动性好、交易活跃的期货合约,通过研究股指期货与标的现货之间的价差关系,运用定价模型对其进行合理估值,谨慎利用股指期货,调整投资组合的风险暴露,及时调整投资组合以期规避市场风险,提高组合的运作效率。 (6) 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)综合分析权证的估值执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素,根据 BS 模型和扩展的标准型权证的价格计算模型,对价值被低估的权证进行投资。 2)由于对权证标的股票未来走势的预期,是分析用权证的杠杆比率高的特点,对权证进行博弈投资。 3)由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,结合证、标的股票市场上不同品种的特点,对权证进行有风险收益比的投资,或利用权证进行风险对冲。 (7) 资产支持证券等品种投资策略 资产支持证券包括资产支持票据(ABN)、资产支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。 本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,结合债券卡洛模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估其内在价值进行投资。 对于监管机构允许基金投资的其他金融工具,本基金将在该类分析收益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行检测投资,以降低组合风险,实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率× 60%+ 上证国债指数收益率× 40%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金,属于中高预期风险,中高预期收益的证券投资基金,通常预期风险与预期收益率中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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆璎芸	罗菲彦
	联系电话	021- 38992806	010- 58560666
	电子邮箱	customer.service@gjja- allianz.com	tgbfxjzcx@mbc.com.cn
客户服务电话		021- 38784766/ 4007000365	95568
传真		021- 50151582	010- 58560798

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.gjja- 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 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	18,975,426.53
本期利润	30,026,142.00
加权平均基金份额本期利润	0.1377
本期基金份额净值增长率	15.45%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末
期末可供分配基金份额利润	0.0879
期末基金资产净值	288,006,441.36
期末基金份额净值	1.1545

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 2017 年 1 月 23 日生效。截至报告期末,本基金成立未满 1 年。

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标准差③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	4.50%	1.23%	3.10%	0.48%	1.40%	0.75%
过去六个月	5.99%	1.02%	6.04%	0.42%	- 0.05%	0.60%
自基金合同生效起至今	15.45%	0.87%	12.10%	0.39%	3.35%	0.48%

注:1、本基金基金合同于 2017 年 1 月 23 日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

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。

3.2.2 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

国联安锐意成长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

(2017 年 1 月 23 日至 2017 年 12 月 31 日)

注:1、本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率× 60%+ 上证国债指数收益率× 40%;

2、本基金基金合同于 2017 年 1 月 23 日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

4、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

国联安锐意成长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、本基金基金合同于 2017 年 1 月 23 日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;

2、* 基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率;

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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2017 年 1 月 23 日生效,截止报告期末,本基金成立未满一年,期间未进行利润分配。

§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		
王超伟	本基金基金经理,兼任国联安春秋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,国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理	2017- 01- 23	-	9年(自 2008 年起)	王超伟,硕士研究生。2008 年 7 月至 2011 年 8 月任国泰君安证券股份有限公司证券投资经理;2011 年 8 月至 2015 年 9 月任国泰君安证券股份有限公司权益投资部投资经理;2015 年 9 月加入国联安基金管理有限公司,担任基金投资经理助理。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基金经理助理;2016 年 3 月起担任国联安信心增长债券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	本基金基金经理助理	2017- 05- 16	2017- 12- 12	8年(自 2009 年起)	-
薛琳	本基金基金经理助理	2017- 08- 16	-	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》、《国联安锐意成长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,自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。

基金管理人的全年操作风格主要以稳健为主。一季度建仓期间,主要以稳健的白酒家电医药为配置方向,虽然仓位不高,但收益较好。二季度继续以大消费板块为配置方向。三季度本基金的仓位有所提升,部分参与了周期股行情。四季度继续以消费类个股为主要配置方向。11 月消费板块整体有所回调,但基金管理人坚守价值理念,在 12 月的反弹过程中,本基金净值基本收复前期跌幅。

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, 本基金净值震荡上行,从没跌破过发行净值。

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 15.45%,同期业绩比较基准收益率为 12.10%。

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。看好大金融中的大行,地产中估值低增速高的公司,同时依然看好有强大研发实力的医药龙头公司。

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、权益投资部、投资组合管理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,本基金本报告期未进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§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 1800962 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:国联安锐意成长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
资产:	-
银行存款	38,470,088.04
结算备付金	948,762.33
存出保证金	294,291.58
交易性金融资产	261,134,023.25
其中:股票投资	260,779,024.81
基金投资	-
债券投资	354,998.44
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	13,443.94
应收股利	-
应收申购款	1,097,764.67
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	301,958,374.81
负债和所有者权益	本期末 2017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	12,520,882.91
应付管理人报酬	378,891.45
应付托管费	63,148.56
应付销售服务费	-
应付交易费用	578,442.59
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	410,567.94
负债合计	13,951,933.45
所有者权益:	-
实收基金	249,474,833.33
未分配利润	38,531,608.03
所有者权益合计	288,006,441.36
负债和所有者权益总计	301,958,374.81

注:1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.1545 元,基金份额总额 249,474,833.33 份;

2、本基金于 2017 年 1 月 23 日成立,截至本报告期末本基金成立不满 1 年,无上年度末数据(下同)。

7.2 利润表

会计主体:国联安锐意成长混合型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	37,203,404.47
1.利息收入	1,180,645.01
其中:存款利息收入	1,180,645.01
债券利息收入	40.46
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	23,306,929.52
其中:股票投资收益	21,400,481.10
基金投资收益	-
债券投资收益	0.00
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	1,906,448.42
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	11,050,715.47
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,665,114.47
减:二、费用	7,177,262.47
1. 管理人报酬	3,324,064.65
2. 托管费	554,010.77
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	2,928,286.10
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	370,900.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	30,026,142.00
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	30,026,142.00

注:本基金于 2017 年 1 月 23 日成立,截至本报告期末本基金成立不满一年,因此本报告实际报告期间为 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日;本基金无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安锐意成长混合型证券投资基金

本报告期:2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2017年 1 月 23 日(基金合同生效日)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)	240,776,601.58	-	240,776,601.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,026,142.00	30,026,142.00
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)	8,698,231.75	8,505,466.03	17,203,697.78
其中:1.基金申购款	430,096,305.30	44,801,926.54	474,898,231.84
2.基金赎回款	- 421,398,073.55	- 36,296,460.51	- 457,694,534.06
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)	249,474,833.33	38,531,608.03	288,006,441.36

注:本基金于 2017 年 1 月 23 日成立,截至本报告期末本基金成立不满一年,无上年度可比期间数据。本表中“期初所有者权益(基金净值)”为基金合同生效日即 2017 年 1 月 23 日的数据。

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

国联安锐意成长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”)《关于准予国联安锐意成长混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2934 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《国联安锐意成长混合型证券投资基金合同》发售,基金合同于 2017 年 1 月 23 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 240,776,601.58 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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金于 2016 年 12 月 19 日至 2017 年 1 月 18 日募集,募集期间净认购资金人民币 240,729,654.56 元,认购资金在募集期间产生的利息人民币 46,947.02 元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 240,776,601.58 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 1700135 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、《国联安锐意成长混合型证券投资基金基金合同》和《国联安锐意成长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(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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:股票投资占基金资产的 60%-95%;权证投资占基金资产净值的 0%-3%;在每个交易日日终扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 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× 60%+ 上证国债指数收益率× 40%。

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、自 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日) 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 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)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所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;
- 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的, 本基金将下列两项金额的差额计入当期损益:

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中, 出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,根据《企业会计准则》的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具, 在估值日有报价的,除会计准则规定的情况外,将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,对报价进行调整,确定公允价值。与上述金融工具相同,但具有不同特征的,以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指