

## 国联安德盛增利债券证券投资基金 2017年年度报告摘要

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、基金托管人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年12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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

2.1 基金基本情况

|      |         |
|------|---------|
| 基金简称 | 国联安增利债券 |
| 基金代码 | 050009  |

|       |        |
|-------|--------|
| 数据源代码 | 253020 |
| 交易代码  | 253020 |

---

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日         | 2009年3月11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    |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 56,770,845.05 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 国联安增利债券 A       | 国联安增利债券 B       |
| 下属分级基金的交易代码     | 253020          | 253021          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 34,318,448.94 份 | 22,452,396.11 份 |

## 2.2 基金产品说明

|      |                                                                   |
|------|-------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 在控制风险与保持资产流动性的基础上,力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。                          |
|      | 本基金根据对宏观经济、宏观调控政策走向以及普通债券市场、可转债市场、股票市场和商品期货收益特征及其资产价格的综合比较,并运用美国国 |

|        |                                                                                     |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资策略   | 策略市场将密切关注收益特征及其风险调整后的综合性价比,首先采用均衡配置策略进行大类资产的配置,在此基础上,再根据对各类资产风险收益特征的进一步分析预测,制定各自策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数                                                                              |

|        |                                                  |
|--------|--------------------------------------------------|
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金,属于证券市场中低风险品种,预期收益和风险高于货币市场基金,低于股票型基金。 |
|--------|--------------------------------------------------|

| 项目 | 基金管理人 |
|----|-------|
|----|-------|

|         |                         |                                  |                    |
|---------|-------------------------|----------------------------------|--------------------|
| 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       |
| 信息披露负责人 | 姓名                      | 陆惠云                              | 郭明                 |
|         | 联系电话                    | 021-38992806                     | 010-66105799       |
|         | 电子邮箱                    | customer.service@tia-allianz.com | custody@cbc.com.cn |
| 客户服务电话  | 021-38784766/4007000365 |                                  | 95588              |
| 传真      | 021-50151582            |                                  | 010-66105798       |

**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 <http://www.gtja.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

## 设计数据和财务指标

|         |       |       |
|---------|-------|-------|
| 2.1.1 吨 | 2017年 | 2016年 |
|---------|-------|-------|

| 财务指标         | 国联安医疗保健A       | 国联安医疗保健B      | 国联安医疗保健A      | 国联安医疗保健B      | 国联安医疗保健A         | 国联安医疗保健B       |
|--------------|----------------|---------------|---------------|---------------|------------------|----------------|
| 本期已收利息       | -11,902,892.93 | -1,237,759.94 | 99,639,914.59 | 5,383,000.31  | 120,336,801.43   | 19,964,109.61  |
| 本期利息收入       | -4,709,785.13  | -2,278,755.74 | 46,082,858.06 | 3,340,869.60  | 147,537,533.15   | 13,823,814.22  |
| 平均金融资产余额     | -0.03377       | -0.0895       | 0.0269        | 0.0358        | 0.1313           | 0.1116         |
| 本期基金净申购率     | -7.10%         | -7.44%        | 1.32%         | 0.86%         | 12.74%           | 12.28%         |
| 3.12 附息类资产占比 | 2017年末         |               | 2016年末        |               | 2015年末           |                |
|              | 国联安医疗保健A       | 国联安医疗保健B      | 国联安医疗保健A      | 国联安医疗保健B      | 国联安医疗保健A         | 国联安医疗保健B       |
| 期末可供分配利润比例   | 0.1359         | 0.1144        | 0.1757        | 0.1587        | 0.1305           | 0.1195         |
| 期末基金份额净值     | 41,739,620.77  | 26,826,787.02 | 89,541,081.64 | 36,856,079.48 | 2,265,327,902.38 | 197,882,031.17 |
| 期末基金份额净值增长率  | 1.216          | 1.195         | 1.309         | 1.291         | 1.292            | 1.280          |

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人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。

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。

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|
|----|----------|------------|------------|--------------|-----|-----|

|            | ①       | ②     | ③       | ④     | ⑤       | ⑥     |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | - 7.81% | 1.05% | - 1.15% | 0.06% | - 6.66% | 0.99% |
| 过去六个月      | - 7.18% | 0.73% | - 1.30% | 0.05% | - 5.88% | 0.68% |
| 过去一年       | - 7.10% | 0.53% | - 3.38% | 0.06% | - 3.72% | 0.47% |
| 过去三年       | 6.11%   | 0.34% | 0.22%   | 0.06% | 5.89%   | 0.26% |
| 过去五年       | 18.36%  | 0.28% | 11.60%  | 0.10% | 6.76%   | 0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.56%  | 0.26% | 23.42%  | 0.08% | 29.14%  | 0.18% |

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. 国联安增利债券 B:

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|

| 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 |
|----|----------|-------------|------------|
|----|----------|-------------|------------|

|             | 10%     | 15%   | 20%     | 25%   | 30%     |
|-------------|---------|-------|---------|-------|---------|
| 过去三个月       | - 7.86% | 1.05% | - 1.15% | 0.06% | - 6.71% |
| 过去六个月       | - 7.36% | 0.73% | - 1.30% | 0.05% | - 6.06% |
| 过去一年        | - 7.44% | 0.52% | - 3.38% | 0.06% | - 4.06% |
| 过去三年        | 4.82%   | 0.34% | 0.22%   | 0.08% | 4.60%   |
| 过去五年        | 16.26%  | 0.28% | 11.60%  | 0.10% | 4.66%   |
| 自基金合同生效以来至今 | 47.54%  | 0.26% | 23.42%  | 0.08% | 24.12%  |

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

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

## 国联安德盛增利债券证类

(2009年3月11日至2017年12月31日)