# 国联安主题驱动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 | 国联安主题驱动混合 |
| 基金主代码 | 257050 |
| 交易代码 | 257050 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年 8 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 | 86, 320, 968.91 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 把握中国经济结构转型带来的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 1. 资产配置策略<br>根据宏观经济发展趋势、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。<br>若出现重大突发事件、投资者情绪急剧变化、海外市场异常变动等因素导致投资决议形成的市场环境发生改变,基金经理可以提出大类资产配置的调整建议,投资决策委员会召开会议,讨论基金经理的建议并确定大类资产的调整比例,由基金经理执行。<br>2. 股票投资策略<br>本基金股票投资运用主题驱动投资策略。通过"自上而下"的分析方法,前瞻性地把握中国经济结构转型过程中涌现的投资主题,结合价值投资理念,精选投资主题下的个股,获取超额收益率。<br>投资主题是影响经济发展或企业盈利前景的趋势性因素。投资主题是动态的,一般分为四个阶段:主题雏形阶段、主题形成阶段、主题繁荣阶段、主题衰退阶段。<br>在主题的雏形阶段,对主题的关注度较低,市场反映往往不足;主题繁荣阶段,主题引起广泛关注,市场反映往往过度。这种反应不足和反应过度就带来投资定价的偏差,即主题雏形阶段,股票往往被低估,而到主题繁荣阶段,股票往往被高估。通过对主题进程的把握,利用这种定价偏差,精选主题下的相关个股,在主题雏形阶段买入,在主题繁荣阶段卖出,形成完整的主题驱动投资策略。<br>3.债券投资策略<br>在债券投资方面,本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。主要的债券投资策略有:<br>(1)久期控制策略<br>(2)类属策略<br>(3)收益率曲线配置策略<br>4.权证投资策略<br>本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证的投资。<br>(1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素,根据 BS 模型和溢价率对权证的合理价值做出判断,对价值被低估的权证进行投资。<br>(2)基于对权证标的股票未来走势的预期,充分利用权证的杠杆比率高的特点,对权证进行单边投资;<br>(3)基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,将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资,或利用权证进行风险对冲。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数× 80%+上证国债指数× 20% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金,在证券投资基金中属于较高风险品种,其预期收益水平和风险低于股票型基金,高于债券型基金。 |

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 | 陆康姿 | 田青 |
| | 联系电话 | 021- 38992806 | 010- 67595096 |
| | 电子邮箱 | customer.service@gtja- allianz.com | tianqing1zh@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 | http://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 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 13, 425, 521.05 | - 165, 666, 973.83 | 16, 042, 065.52 |
| 本期利润 | 33, 772, 595.69 | - 233, 910, 698.44 | 59, 024, 280.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2973 | - 1.0909 | 0.6068 |
| 本期基金份额净值增长率 | 26.08% | - 41.77% | 42.61% |
| 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 | 0.1632 | 0.0147 | 0.7645 |
| 期末基金资产净值 | 127, 872, 101.47 | 170, 093, 518.05 | 623, 163, 133.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.4814 | 1.175 | 2.018 |

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。

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

| 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 | 8.56% | 1.04% | 4.09% | 0.64% | 4.47% | 0.40% |
| 过去六个月 | 12.83% | 0.86% | 7.98% | 0.56% | 4.85% | 0.30% |
| 过去一年 | 26.08% | 0.81% | 17.32% | 0.51% | 8.76% | 0.30% |
| 过去三年 | 4.69% | 2.42% | 15.27% | 1.35% | - 10.58% | 1.07% |
| 过去五年 | 60.50% | 2.05% | 54.08% | 1.24% | 6.42% | 0.81% |
| 自基金合同生效起至今 | 48.14% | 1.77% | 35.26% | 1.21% | 12.88% | 0.56% |

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

国联安主题驱动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

(2009 年 8 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× 80%+ 上证国债指数× 20%;

2、本基金基金合同于 2009 年 8 月 26 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 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 过去五年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

国联安主题驱动混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

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。

3.3 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 | - | - | - | - | - |
| 2016 | - | - | - | - | - |
| 2015 | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - |

## § 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 | | |
| 潘明 | 本基金基金经理、兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理、国联安科技动力股票型证券投资基金基金经理 | 2015- 04- 28 | 2017- 02- 27 | 8年(自 2009 年起) | 潘明,硕士研究生,1996 年 6 月至 1998 年 6 月在计算机科学公司担任咨询师;1998 年 8 月至 2005 年 5 月在摩托罗拉公司担任高级行政工程师;2003 年 1 月至 2003 年 12 月在扎克斯投资管理公司担任投资分析师;2004 年 4 月至 2005 年 5 月在短剑投资公司担任执行董事;2005 年 5 月至 2009 年 7 月在指导资本公司担任基金经理兼大宗商品研究总监;2009 年 8 月至 2010 年 3 月在海通证券股份有限公司担任投资经理;2010 年 1 月至 2013 年 1 月在 GCS 母基金公司、GCS 有限公司、GCS 有限责任合伙公司担任独立董事;2010 年 3 月至 2012 年 10 月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理助理;2012 年 10 月至 2013 年 12 月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理。2013 年 12 月起加入国联安基金管理有限公司,担任基金经理助理。2014 年 2 月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月起兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金。2015 年 4 月至 2017 年 2 月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金基金经理。2016 年 1 月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金基金经理。 |
| 张汉毅 | 本基金基金经理 | 2016- 12- 23 | - | 6年(自 2011 年起) | 张汉毅,硕士研究生,2009 年 7 月至 2011 年 4 月在工业和信息化部电信研究院通信计量中心担任测试工程师,2011 年 4 月至 2012 年 5 月在光大证券股份有限公司资产管理总部担任行业研究员。2012 年 5 月至 2013 年 11 月在上海光大证券资产管理有限公司担任行业研究员。2013 年 12 月加入国联安基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理。2016 年 12 月起任国联安主题驱动混合型证券投资基金基金经理。 |
| 郑青 | 本基金基金经理助理 | 2015- 04- 09 | - | 7年(自 2010 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》、《国联安主题驱动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

本基金在 2017 年整体操作稳健,以行业景气度为抓手,自上而下选取高景气度行业中的优秀龙头个股进行配置,注重估值与业绩增长的结合,重点配置了食品饮料、家电、银行、保险、医药、电子等板块,整体契合了全年市场偏向蓝筹白马的风格,取得了不错的投资业绩。同时,由于配置均衡,也在一定程度上减少了回撤的风险。

对于年初及三季度市场出现的周期股机会,本基金没有很好地把握,主要受制能力圈的限制,但在此过程中也进行了一定程度的轻仓参与,对于行业间比较借鉴及把握市场风格也起到积极作用。

总体来看,2017 年是价值投资继续发展壮大的一年, 各个行业内的优秀龙头,在未来经济增速下降的背景下,成为海内外资金共同追捧的对象,迎来了业绩和估值的双升。本基金在坚持价值投资理念的基础下,重点关注行业景气度的更迭,适当考虑筹码及博弈层面要素,未来也将继续沿此方向前行。

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 26.08%,同期业绩比较基准收益率为 17.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

如果说 2017 年投资蓝筹白马获取收益的方式简单粗暴,那么 2018 年 A 股市场将迎来更加复杂和多变的市场格局。

一方面,国内外宏观经济的走势和市场预期之间的博弈在加强,虽然目前来看全球经济还是稳中向好,但是由于资本市场已经反映了一定的乐观预期,因此后续如果出现负面的边际变化将有可能对国内外市场带来巨大冲击,特别是美股经历 9 年牛市、A 股经历 2 年慢牛之后,获利资金的撤出是情理之中。

另一方面,从 A 股市场而言,虽然前期蓝筹白马等龙头涨幅已经较大,但是从估值角度看并未出现绝对高估的情况,2016、2017 年支撑蓝筹白马领涨的大逻辑未变,目前主要扰动因素在于机构抱团等筹码分布的因素,而非基本面因素,因此即使经历调整也仍是未来值得期待的方向。与之相对应的,中小盘股票,特别是那些行业竞争格局还在崩溃变化的股票,未来自身的发展还存在极大的不确定性,此前经历了股价的大幅回调,部分优秀企业已经在估值上逐渐具有吸引力,但由于未来失败概率大,因此从中筛选的难度也相应较大,这种高风险高回报的机会对自下而上的选股能力提出更高要求。

从行业层面,本基金认为大消费、金融、科技是未来需要重点关注的板块,其中大消费、金融延续 2017 年的龙头选股思路,而科技板块目前来看行业景气度有压力(创新步伐放慢),需更注重自下而上的思路选取个股。

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, 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,本基金未实施利润分配。

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, 注册会计师王国蓓、张楠签字出具了毕马威华振审字第 1800161 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:国联安主题驱动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 | 25, 613, 093.95 | 34, 922, 182.34 |
| 结算备付金 | 231, 673.94 | 254, 426.77 |
| 存出保证金 | 46, 649.53 | 63, 106.36 |
| 交易性金融资产 | 102, 530, 002.08 | 136, 571, 672.08 |
| 其中:股票投资 | 102, 530, 002.08 | 136, 571, 672.08 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 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 | 837, 736.36 | - |
| 应收利息 | 6, 023.76 | 5, 217.41 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 32, 007.80 | 82, 554.39 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 129, 297, 187.42 | 171, 899, 159.35 |
| 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 | 763, 660.49 | - |
| 应付赎回款 | 50, 368.76 | 877, 999.20 |
| 应付管理人报酬 | 163, 090.60 | 222, 606.62 |
| 应付托管费 | 27, 181.76 | 37, 101.11 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 125, 731.62 | 390, 070.67 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 295, 052.72 | 277, 863.70 |
| 负债合计 | 1, 425, 085.95 | 1, 805, 641.30 |
| 所有者权益: | - | - |
| 实收基金 | 86, 320, 968.91 | 144, 774, 563.72 |
| 未分配利润 | 41, 551, 132.56 | 25, 318, 954.33 |
| 所有者权益合计 | 127, 872, 101.47 | 170, 093, 518.05 |
| 负债和所有者权益总计 | 129, 297, 187.42 | 171, 899, 159.35 |

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.4814 元,基金份额总额 86,320,968.91 份。

7.2 利润表

会计主体:国联安主题驱动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 | 37, 808, 992.27 | - 225, 751, 541.36 |
| 1.利息收入 | 189, 448.03 | 185, 968.87 |
| 其中:存款利息收入 | 189, 448.03 | 185, 968.87 |
| 债券利息收入 | - | - |
| 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) | 17, 193, 794.76 | - 158, 743, 787.94 |
| 其中:股票投资收益 | 15, 808, 811.32 | - 159, 030, 071.14 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 0.00 | 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, 384, 983.44 | 286, 283.20 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 20, 347, 074.64 | - 68, 243, 724.61 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 78, 674.84 | 1, 050, 002.32 |
| 减:二、费用 | 4, 036, 396.58 | 8, 159, 157.08 |
| 1. 管理人报酬 | 2, 214, 630.16 | 4, 512, 549.30 |
| 2. 托管费 | 369, 105.08 | 752, 091.51 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 1, 150, 486.18 | 2, 595, 405.22 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 302, 175.16 | 299, 111.05 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 33, 772, 595.69 | - 233, 910, 698.44 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 33, 772, 595.69 | - 233, 910, 698.44 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安主题驱动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) | 144, 774, 563.72 | 25, 318, 954.33 | 170, 093, 518.05 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 33, 772, 595.69 | 33, 772, 595.69 |
| 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) | - 58, 453, 594.81 | - 17, 540, 417.46 | - 75, 994, 012.27 |
| 其中:1.基金申购款 | 13, 725, 835.08 | 3, 621, 500.83 | 17, 347, 335.91 |
| 2.基金赎回款 | - 72, 179, 429.89 | - 21, 161, 918.29 | - 93, 341, 348.18 |
| 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) | 86, 320, 968.91 | 41, 551, 132.56 | 127, 872, 101.47 |
| 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) | 308, 744, 978.56 | 314, 418, 154.70 | 623, 163, 133.26 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | - 233, 910, 698.44 | - 233, 910, 698.44 |
| 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) | - 163, 970, 414.84 | - 55, 188, 501.93 | - 219, 158, 916.77 |
| 其中:1.基金申购款 | 439, 530, 389.83 | 197, 625, 715.46 | 637, 156, 105.29 |
| 2.基金赎回款 | - 603, 500, 804.67 | - 252, 814, 217.39 | - 856, 315, 022.06 |
| 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) | 144, 774, 563.72 | 25, 318, 954.33 | 170, 093, 518.05 |

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

国联安主题驱动混合型证券投资基金 (以下简称"本基金")(原"国联安主题驱动股票型证券投资基金")经中国证券监督管理委员会 (以下简称"中国证监会")《关于核准国联安主题驱动股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可 [2010] 542 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》等相关法规和《国联安主题驱动股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2009 年 8 月 26 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 843,660,229.43 份基金份额。根据《国联安基金管理有限公司关于旗下五只基金变更基金名称的公告》,自 2015 年 8 月 8 日起,"国联安主题驱动股票型证券投资基金"更名为"国联安主题驱动混合型证券投资基金"。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、《国联安主题驱动混合型证券投资基金基金合同》和《国联安主题驱动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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产 60% - 95%,债券、现金、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许投资的其他证券品种 5% - 40%,其中权证投资 0.3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数× 80%+ 上证国债指数× 20% 。

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

根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》(以下简称"估值指引")的规定,本基金自 2017 年 12 月 22 日起,对本基金持有的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票的估值方法进行调整,参考估值指引进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(a)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税 (以下称营改增) 试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日 (含) 以后,资管产品管理人 (以下称管理人) 运营基金过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额:持股期限在 1 个月以内 (含 1 个月) 的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的,暂减按 25%计入应纳税所得额,股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的,暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者 (包括个人和机构投资者) 从基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 国联安基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司("建设银行") | 基金托管人 |
| 国泰君安证券股份有限公司("国泰君安") | 基金管理人的股东 |
| 安联集团 | 基金管理人的股东 |
| 中德安联人寿保险有限公司("中德安联") | 基金管理人的股东控制的公司 |

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

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

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间,本基金无应支付关联方的佣金。

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 