

**国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金**  
**2015 年半年度报告**  
**2015 年 6 月 30 日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

## 1 重要提示及目录

### 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。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 4 月 8 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11 |
| 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.....             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....      | 13 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 13 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13 |
| 6.2 利润表.....                                 | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 16 |
| 6.4 报表附注.....                                | 17 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 38 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 38 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 42 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 42 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 43 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....   | 43 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 43 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 43 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 43 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....                | 45 |

|   |           |
|---|-----------|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 ..... | 45        |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | <b>45</b> |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 46        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....  | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 46        |
| 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....               | 46        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 48        |
| <b>11 备查文件目录</b> .....                  | <b>51</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                        | 51        |
| 11.2 存放地点.....                          | 51        |
| 11.3 查阅方式.....                          | 52        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 国联安睿祺灵活配置混合        |
| 基金主代码      | 001157             |
| 交易代码       | 001157             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015 年 4 月 8 日     |
| 基金管理人      | 国联安基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 5,105,617,382.82 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司力争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。 |
| 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 | 本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平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                       | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 陆康芸                               | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 021-38992806                      | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | customer.service@gtja-allianz.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 021-38784766/4007000365           | 95555                  |
| 传真          |      | 021-50151582                      | 0755-83195201          |
| 注册地址        |      | 上海市浦东新区陆家嘴环路<br>1318号星展银行大厦9楼     | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦     |

|       |                               |                        |
|-------|-------------------------------|------------------------|
| 办公地址  | 上海市浦东新区陆家嘴环路<br>1318号星展银行大厦9楼 | 深圳市深南大道7088号招商银<br>行大厦 |
| 邮政编码  | 200121                        | 518040                 |
| 法定代表人 | 庹启斌                           | 李建红                    |

## 2.4 信息披露方式

|                      |  |
|----------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 中国证券报、上海证券报、证券时报                                   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gtja-allianz.com 或<br>www.vip-funds.com |
| 基金半年度报告备置地点          | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银<br>行大厦 9 楼                  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称          | 办公地址                              |
|--------|-------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国联安基金管理有限公司 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银<br>行大厦 9 楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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 | 报告期（2015年4月8日（基金合同生效日）至<br>2015年6月30日） |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | 14,773,421.12                          |
| 本期利润          | 29,375,485.46                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0085                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.85%                                  |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.50%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日)                       |
| 期末可供分配利润      | 14,908,869.05                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0029                                 |
| 期末基金资产净值      | 5,131,753,004.71                       |
| 期末基金份额净值      | 1.005                                  |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2015年6月30日)                       |
| 基金份额累计净值增长率   | 0.50%                                  |

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 2015 年 4 月 8 日生效。截至报告期末，本基金成立未满 6 个月。

### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.40%    | 0.07%       | -3.34%     | 1.75%         | 3.74%  | -1.68% |
| 过去三个月      | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 过去六个月      | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 过去一年       | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 自基金合同生效起至今 | 0.50%    | 0.07%       | 3.50%      | 1.35%         | -3.00% | -1.28% |

注：1、本基金基金合同于 2015 年 4 月 8 日生效，截止至本报告期末本基金成立不满半年；

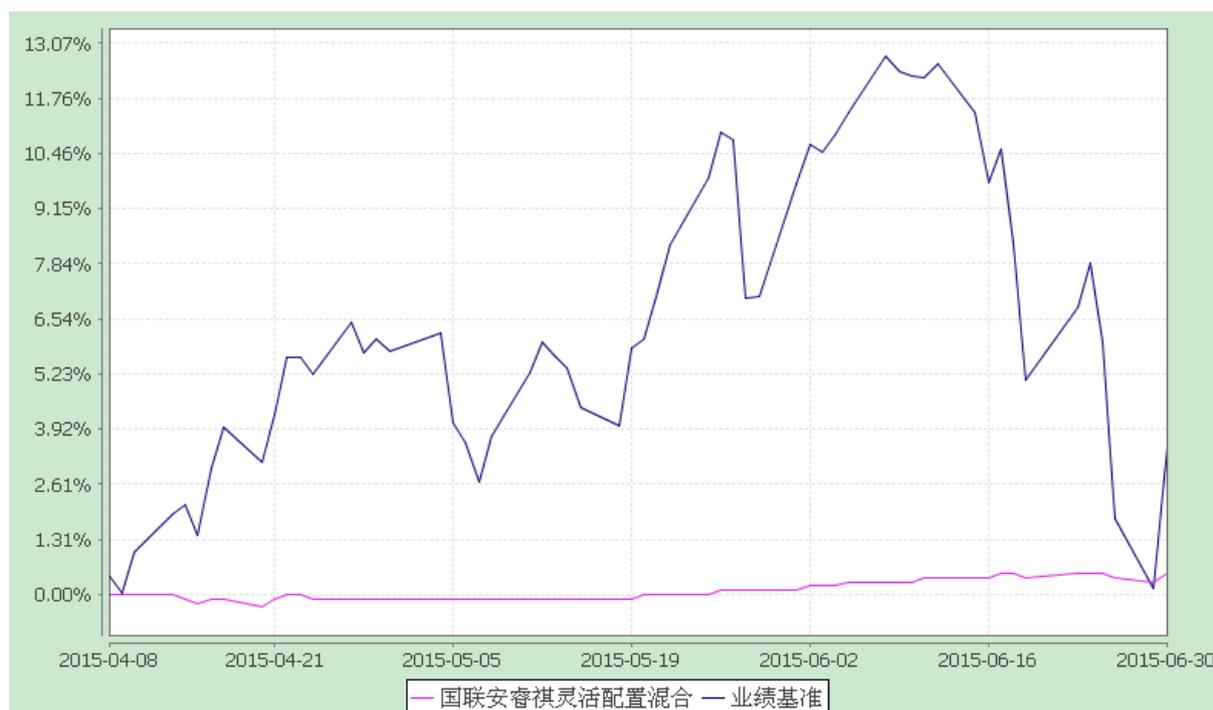
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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

国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 4 月 8 日至 2015 年 6 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×50%+上证国债指数×50%；  
 2、本基金基金合同于 2015 年 4 月 8 日生效。截至报告期末，本基金成立不满半年；  
 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；  
 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。

## 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，公司共管理二十八只开放式基金。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 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-----------|------|----|
|----|----|-----------|------|----|

|    |  | (助理) 期限    |            | 年限               |  |
|----|--|------------|------------|------------------|--|
|    |  | 任职日期       | 离任日期       |                  |  |
| 周平 | 本基金基金经理、国联安新精选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的基金经理、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理 | 2015-04-08 | 2015-06-23 | 10 年(自 2005 年起)  | 周平, 硕士研究生, 2004 年 8 月至 2005 年 7 月在普华永道(上海)会计师事务所担任审计师;2006 年 6 月至 2008 年 4 月在中信资本资产管理有限公司担任分析师。2008 年 5 月起加入国联安基金管理有限公司,担任研究员。2014 年 3 月至 2015 年 6 月任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 1 月至 2015 年 6 月为国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 2 月至 2015 年 6 月兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月至 2015 年 6 月兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月至 2015 年 6 月兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月 2 日至 2015 年 6 月 23 日兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 冯俊 | 本基金基金经理、兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安双佳信用债券型证券投资基金 (LOF)、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、国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理、国联安   | 2015-04-08 | -          | 14 年 (自 2001 年起) | 冯俊先生, 复旦大学经济学博士。曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管,光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员,长盛基金管理有限公司基金经理助理,泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理。2008 年 10 月起加入国联安基金管理有限公司,现任债券组合管理部总监, 2009 年 3 月至 2015 年 3 月任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2010 年 6 月至 2013 年 7 月兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理, 2011 年 1 月至 2012 年 7 月兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理,2013 年 7 月至 2015 年 6 月任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月起兼任国联安信心增  |

|     |   |            |            |                 |  |
|-----|---|------------|------------|-----------------|--|
|     | 添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监。  |            |            |                 | 长债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起兼任国联安鑫安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月起兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月起兼任国联安鑫富混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理。   |
| 李广瑜 | 本基金基金经理、兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、国联安保本混合型证券投资基金、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理 | 2015-06-12 | -          | 6 年 (自 2009 年起) | 李广瑜先生, 硕士研究生, 注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)。2005 年 1 月至 2006 年 8 月在晨星资讯有限公司担任分析师; 2006 年 9 月至 2009 年 8 月在渣打银行有限责任公司担任国际管理培训生; 2009 年 9 月至 2011 年 8 月在海富通基金管理有限公司担任债券投资经理, 2011 年 8 月至 2013 年 6 月在太平资产管理有限公司担任债券投资经理。2013 年 6 月起加入国联安基金管理有限公司。2013 年 11 月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理。2013 年 12 月起兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2015 年 3 月起兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理。2015 年 6 月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。 |
| 李广瑜 | 本基金基金经理助理   | 2015-05-06 | 2015-06-11 | 6 年 (自 2009 年起) | -  |
| 林涿  | 本基金基金经理助理、兼任研究部行业研  | 2015-05-04 | -          | 4 年 (自 2011 年起) | -  |

|     |   |            |            |                 |   |
|-----|---|------------|------------|-----------------|---|
|     | 究员  |            |            |                 |   |
| 吕中凡 | 本基金基金经理助理、兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金 (LOF)、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2015-04-09 | 2015-05-06 | 4 年 (自 2011 年起) | - |

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《国联安睿祺灵活配置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 公平交易制度的执行情况

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，及时执行交易系统内的公平交易模块；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。公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 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

回顾 2015 年上半年，经济下行压力大于预期，经济回升的内生动力弱于预期。政策放松趋势没有改变。当前经济仅仅是短期企稳，经济自主增长动能暂难以逆转。不仅实际利率高，社会融资总量增速也持续放缓，这些都对总需求有滞后影响，经济经过短期企稳后，可能在 2016 年继续下行。通缩环境没有改变，二季度 GDP 缩减指数为负，未来几个季度 GDP 缩减指数依然将为负。

在此背景下，我们预计下半年信用债供给逐季回升，货币政策将以定向宽松为主，且随着股市震荡不断加剧，配资、打新等资金短期内会选择观望或进入债市避险，预计股市对债市的分流高峰已经过去，股票市场预计难呈现上半年牛市格局，波动性将会加大。

考虑到保持基金净值增长率的平稳性，在基本配置上本基金第二季度股票维持了较低的仓位，用更多的资金积极参与了新股的发行，取得了良好的收益，同时也将富余的资金适当的配置在了高流动性债券和回购类资产，取得了较好的基础性收益。

今年下半年经济下行压力较大，流动性补充需求迫切，定向宽松仍是首要选项，所以本基金还是继续延续之前的投资思路，维持基础性收益，通过一级市场权益投资追求超额收益机会，获取较为稳定的投资回报。

##### 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 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 3.50%。

#### 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 2015 年下半年，我们预计经济下行压力较大，通胀仍在低位，财政政策的发力和地方债的增量发行仍然需要货币政策的配合，定向宽松将是首选，资金利率将维持低位运行。且随着股市震荡不断加剧，配资、打新等资金短期内会选择观望或进入债市避险，预计股市对债市的分流高峰已经过去，股票市场预计难呈现上半年牛市格局，波动性将会加大。银行理财和打新基金将继续加大债券资产配置，债券市场将迎来一波资金面和基本面都比较支持的行情。出于流动性考虑，中高等级信用债尤其是中短期信用债仍将是理财资金资金的配置首选。我们对下半年债市保持乐观。考虑到保持基金净值增长率的平稳性，在基本配置上本基金将加大中高等级流动性较高的中短期信用债债券资产配置，适当增加杠杆提高债券资产的收益。

#### 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基金事务部、投资组合管理

部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、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，数量策略部、研究部、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，本基金本报告期末进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

## 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

托管人声明：在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,438,792,296.76               |
| 结算备付金           |            | 25,990,917.24                  |
| 存出保证金           |            | 107,357.32                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 2,594,557,575.67               |
| 其中：股票投资         |            | 133,067,398.11                 |
| 基金投资            |            | -                              |
| 债券投资            |            | 2,461,490,177.56               |
| 资产支持证券投资        |            | -                              |
| 贵金属投资           |            | -                              |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 1,100,002,250.00               |
| 应收证券清算款         |            | -                              |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 18,292,856.93                  |
| 应收股利            |            | -                              |
| 应收申购款           |            | 2,435,169.19                   |
| 递延所得税资产         |            | -                              |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>5,180,178,423.11</b>        |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            | -                              |
| 短期借款            |            | -                              |
| 交易性金融负债         |            | -                              |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              |
| 应付证券清算款         |            | 20,487,257.64                  |
| 应付赎回款           |            | 20,086,713.38                  |
| 应付管理人报酬         |            | 6,275,319.98                   |
| 应付托管费           |            | 1,045,886.64                   |
| 应付销售服务费         | 6.4.7.7    | -                              |
| 应付交易费用          |            | 392,380.04                     |
| 应交税费            |            | -                              |
| 应付利息            |            | -                              |
| 应付利润            |            | -                              |
| 递延所得税负债         |            | -                              |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 137,860.72                     |
| <b>负债合计</b>     |            | <b>48,425,418.40</b>           |

|                   |          |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                       |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 5,105,617,382.82        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 26,135,621.89           |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>5,131,753,004.71</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>5,180,178,423.11</b> |

注：1.报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 5,105,617,382.82 份。

2.本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满 6 个月，无上年度末数据（下同）。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|---|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>46,961,112.27</b>                              |
| 1.利息收入                |          | 14,498,912.40                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 2,782,929.33                                      |
| 债券利息收入                |          | 7,029,969.17                                      |
| 资产支持证券利息收入            |          | -   |
| 买入返售金融资产收入            |          | 4,686,013.90                                      |
| 其他利息收入                |          | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 16,101,415.53                                     |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 15,943,065.53                                     |
| 基金投资收益                |          | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | -68,900.00  |
| 资产支持证券投资收益            |          | -   |
| 贵金属投资收益               |          | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14 | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.15 | 227,250.00  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 14,602,064.34                                     |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17 | 1,758,720.00                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>17,585,626.81</b>                              |
| 1. 管理人报酬              |          | 11,902,301.48                                     |
| 2. 托管费                |          | 1,983,716.91                                      |
| 3. 销售服务费              |          | -   |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.18 | 578,829.36  |

|                            |          |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|
| 5. 利息支出                    |          | 3,005,371.01         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 3,005,371.01         |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 115,408.05           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>29,375,485.46</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>29,375,485.46</b> |

注：本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满 6 个月，因此本报告实际报告期间为 2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日；本基金无上年度可比期间数据（下同）。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 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）                        | 619,398,446.67                                 | -             | 619,398,446.67   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 29,375,485.46 | 29,375,485.46    |
| 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）      | 4,486,218,936.15                               | -3,239,863.57 | 4,482,979,072.58 |
| 其中：1.基金申购款                             | 4,849,376,529.61                               | -2,620,205.31 | 4,846,756,324.30 |
| 2.基金赎回款                                | -363,157,593.46                                | -619,658.26   | -363,777,251.72  |
| 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）                        | 5,105,617,382.82                               | 26,135,621.89 | 5,131,753,004.71 |

注：1、本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满 6 个月，无上年度可比期间数据（下同）。本表中“期初所有者权益（基金净值）”为基金合同生效日即 2015 年 4 月 8 日的数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国联安睿祺灵活配置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”)《关于核准国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]388 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《国联安睿祺活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2015 年 4 月 8 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 619,398,446.67 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金于 2015 年 3 月 31 日至 2015 年 4 月 2 日募集，募集期间净认购资金人民币 619,355,836.38 元，认购资金在募集期间产生的利息人民币 42,610.29 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 619,398,446.67 份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了毕马威华振验字第 1500456 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、《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国联安睿祺灵活配置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/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、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票投资占基金资产净值的 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；在扣除股指期货和国债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不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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。

### 6.4.2 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公告[2010]5号《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。

#### 6.4.3 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的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况、2015半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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2015年4月8日(基金合同生效日)至2015年6月30日止。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 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、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票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。

—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(包括交易性金融资产或金融负债)

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。

—应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

—其他金融负债

其他金融负债是指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

#### 6.4.4.4 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，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。应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

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：

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

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。

#### 6.4.4.5 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。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并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。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

—本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

—本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金

份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提。

根据《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的50%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配的有关业务规则进行调整，并及时公告。法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基

金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称“《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》”),若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本,按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种,根据《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[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》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) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 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。
- (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，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业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，暂减按 25% 计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
- (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，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 1,438,792,296.76       |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 1,438,792,296.76       |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 116,382,684.63         | 133,067,398.11 | 16,684,713.48 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |

|        |       |                  |                  |               |
|--------|-------|------------------|------------------|---------------|
| 债券     | 交易所市场 | 485,265,463.83   | 485,001,177.56   | -264,286.27   |
|        | 银行间市场 | 1,978,307,362.87 | 1,976,489,000.00 | -1,818,362.87 |
|        | 合计    | 2,463,572,826.70 | 2,461,490,177.56 | -2,082,649.14 |
| 资产支持证券 |       | -                | -                | -             |
| 基金     |       | -                | -                | -             |
| 其他     |       | -                | -                | -             |
| 合计     |       | 2,579,955,511.33 | 2,594,557,575.67 | 14,602,064.34 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末（2015 年 6 月 30 日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 1,100,002,250.00       | -         |
| 合计    | 1,100,002,250.00       | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末（2015 年 6 月 30 日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 279,554.66             |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 11,695.90              |
| 应收债券利息     | 17,223,260.13          |
| 应收买入返售证券利息 | 778,297.94             |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 其他         | 48.30                  |
| 合计         | 18,292,856.93          |

注：此处其他列示的是基金上交所和深交所结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本报告期末（2015 年 6 月 30 日）本基金未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 358,506.74             |
| 银行间市场应付交易费用 | 33,873.30              |
| 合计          | 392,380.04             |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 29,726.68              |
| 其他应付款       | -                      |
| 预提费用        | 108,134.04             |
| 合计          | 137,860.72             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|--|------------------|
|               | 基金份额（份）  | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 619,398,446.67                                 | 619,398,446.67   |
| 本期申购          | 4,849,376,529.61                               | 4,849,376,529.61 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -363,157,593.46                                | -363,157,593.46  |
| 本期末           | 5,105,617,382.82                               | 5,105,617,382.82 |

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期利润           | 14,773,421.12 | 14,602,064.34 | 29,375,485.46 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 135,447.93    | -3,375,311.50 | -3,239,863.57 |
| 其中：基金申购款       | 205,289.15    | -2,825,494.46 | -2,620,205.31 |

|         |               |               |               |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 基金赎回款   | -69,841.22    | -549,817.04   | -619,658.26   |
| 本期已分配利润 | -             | -             | -             |
| 本期末     | 14,908,869.05 | 11,226,752.84 | 26,135,621.89 |

注：本基金基金合同于 2015 年 4 月 8 日生效，截至本报告期末本基金成立不满 6 个月，因此本报告实际报告期间为 2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日；本基金基金合同生效日无已实现利润。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入  | 2,648,543.38                                   |
| 定期存款利息收入  | -  |
| 其他存款利息收入  | -  |
| 结算备付金利息收入 | 42,375.87                                      |
| 其他        | 92,010.08                                      |
| 合计        | 2,782,929.33                                   |

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|--|
| 卖出股票成交总额   | 158,179,402.02                                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 142,236,336.49                                 |
| 买卖股票差价收入   | 15,943,065.53                                  |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2015 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------------------------|--|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -68,900.00                                     |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -  |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -  |
| 合计                            | -68,900.00                                     |

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                            |
|-------------------------|-------------------------------|
|                         | 2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 100,769,697.27                |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 100,455,100.00                |
| 减：应收利息总额                | 383,497.27                    |
| 买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入   | -68,900.00                    |

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期                            |
|-------------|-------------------------------|
|             | 2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 227,250.00                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                             |
| 合计          | 227,250.00                    |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                            |
|------------|-------------------------------|
|            | 2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
| 1.交易性金融资产  | 14,602,064.34                 |
| ——股票投资     | 16,684,713.48                 |
| ——债券投资     | -2,082,649.14                 |
| ——资产支持证券投资 | -                             |
| ——基金投资     | -                             |
| ——贵金属投资    | -                             |
| 2.衍生工具     | -                             |

|        |               |
|--------|---------------|
| ——权证投资 | -             |
| 3.其他   | -             |
| 合计     | 14,602,064.34 |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|---------|-------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,576,299.06                        |
| 转换费收入   | 182,420.94                          |
| 合计      | 1,758,720.00                        |

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|-----------|-------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 564,854.36                          |
| 银行间市场交易费用 | 13,975.00                           |
| 合计        | 578,829.36                          |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|--------|-------------------------------------|
| 审计费用   | 25,074.84                           |
| 信息披露费  | 83,059.20                           |
| 银行划款费用 | 6,874.01                            |
| 其他     | 400.00                              |
| 合计     | 115,408.05                          |

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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         |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）   | 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 |

#### 6.4.10 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。

本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满 6 个月，无上年度可比期间数据（下同）。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |              |
|-------|-------------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                                | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰君安  | 398,818,823.82                      | 100.00%      |

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |              |
|-------|-------------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                                | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国泰君安  | 153,446,102.98                      | 100.00%      |

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |                |
|-------|-------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                                | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国泰君安  | 6,303,500,000.00                    | 100.00%        |

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |                |            |                  |
|-------|-------------------------------------|----------------|------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                            | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额   | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 国泰君安  | 358,506.74                          | 100.00%        | 358,506.74 | 100.00%          |

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券研究服务协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|-----------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 11,902,301.48                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,238,011.72                        |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|----------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,983,716.91                        |

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

| 本期                            |               |      |       |      |       |      |
|-------------------------------|---------------|------|-------|------|-------|------|
| 2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |               |      |       |      |       |      |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称        | 债券交易金额        |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                               | 基金买入          | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 国泰君安                          | 53,307,901.37 | -    | -     | -    | -     | -    |

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末（2015年6月30日），除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期                            |              |
|------------|-------------------------------|--------------|
|            | 2015年4月8日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |              |
|            | 期末余额                          | 当期利息收入       |
| 招商银行股份有限公司 | 1,438,792,296.76              | 2,648,543.38 |

注：1.本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

2.本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2015年6月30日的相关余额为人民币25,990,917.24元。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |          |            |      |                |       |        |           |               |               |    |
|----------------------|----------|------------|------|----------------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称     | 成功认购日      | 可流通日 | 流通受限类型         | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股)  | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 603838               | 四通股份     | 2015-06-23 | -    | 网下中签           | 7.73  | 7.73   | 18,119    | 140,059.87    | 140,059.87    | -  |
| 300480               | 光力科技     | 2015-06-25 | -    | 网下中签           | 7.28  | 7.28   | 7,263     | 52,874.64     | 52,874.64     | -  |
| 300487               | 蓝晓科技     | 2015-06-24 | -    | 网下中签           | 14.83 | 14.83  | 10,700    | 158,681.00    | 158,681.00    | -  |
| 300488               | 恒锋工具     | 2015-06-25 | -    | 网下中签<br>(含限售期) | 20.11 | 20.11  | 71,341    | 1,434,667.51  | 1,434,667.51  | -  |
| 300489               | 中飞股份     | 2015-06-24 | -    | 网下中签           | 17.56 | 17.56  | 7,319     | 128,521.64    | 128,521.64    | -  |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |          |            |      |                |       |        |           |               |               |    |
| 证券代码                 | 证券名称     | 成功认购日      | 可流通日 | 流通受限类型         | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：张)  | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
| 122384               | 15 中信 01 | 2015-06-25 | -    | 分销债券           | 99.99 | 99.99  | 1,000,000 | 99,989,917.81 | 99,989,917.81 | -  |
| 122388               | 15 华泰 D1 | 2015-06-30 | -    | 分销债券           | 99.98 | 99.98  | 1,000,000 | 99,981,589.04 | 99,981,589.04 | -  |
| 122377               | 14 首开债   | 2015-06-05 | -    | 分销债券           | 99.97 | 99.97  | 600,000   | 59,981,063.02 | 59,981,063.02 | -  |
| 112247               | 15 华东债   | 2015-05-21 | -    | 分销债券           | 99.97 | 99.97  | 400,000   | 39,987,638.36 | 39,987,638.36 | -  |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票 | 股票 | 停牌 | 停牌 | 期末估 | 复牌 | 复牌 | 数量 | 期末 | 期末 | 备注 |
|----|----|----|----|-----|----|----|----|----|----|----|
|----|----|----|----|-----|----|----|----|----|----|----|

| 代码     | 名称   | 日期         | 原因     | 值单价    | 日期         | 开<br>盘<br>单<br>价 | (单位: 股)  | 成本总额       | 估值总额         |   |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|------------------|----------|------------|--------------|---|
| 300467 | 迅游科技 | 2015-06-25 | 重大事项停牌 | 297.30 | 2015-07-02 | 267.57           | 3,726.00 | 125,752.50 | 1,107,739.80 | - |

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元, 因此没有作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元, 因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金基金管理人的风险控制组织体系分为三个层次: 第一层次为董事会及督察长; 第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部; 第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具, 识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险, 向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告, 确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2015年6月30日 |
|--------|-------------------|
| A-1    | 780,827,000.00    |
| A-1 以下 | -                 |
| 未评级    | 640,414,000.00    |
| 合计     | 1,421,241,000.00  |

注：1、本报告期末，未评级的短期信用债券是超短期融资债券；

2、本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满半年，无上年度末数据。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2015年6月30日 |
|--------|-------------------|
| AAA    | 569,601,557.36    |
| AAA 以下 | 319,947,620.20    |
| 未评级    | -                 |
| 合计     | 889,549,177.56    |

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资；

2、根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级；

3、本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满半年，无上年度末数据。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015 年 6 月 30<br>日 | 1 个月以<br>内       | 1-3<br>个月 | 6 个月以<br>内 | 3 个月<br>-1 年     | 6 个月<br>-1 年 | 1 年以内 | 1-5 年          | 5 年以上 | 不计息            | 合计               |
|---------------------------|------------------|-----------|------------|------------------|--------------|-------|----------------|-------|----------------|------------------|
| 资产                        |                  |           |            |                  |              |       |                |       |                |                  |
| 银行存款                      | 1,438,792,296.76 | -         | -          | -                | -            | -     | -              | -     | -              | 1,438,792,296.76 |
| 结算备付金                     | 25,990,917.24    | -         | -          | -                | -            | -     | -              | -     | -              | 25,990,917.24    |
| 存出保证金                     | 107,357.32       | -         | -          | -                | -            | -     | -              | -     | -              | 107,357.32       |
| 交易性金融资产                   | -                | -         | -          | 1,826,365,630.53 | -            | -     | 635,124,547.03 | -     | 133,067,398.11 | 2,594,557,575.67 |
| 衍生金融资产                    | -                | -         | -          | -                | -            | -     | -              | -     | -              | -                |
| 买入返售金融                    | -                | -         | -          | -                | -            | -     | -              | -     | 1,100,002.     | 1,100,000        |

|           |                  |   |   |                  |   |   |                |   |                  |                  |
|-----------|------------------|---|---|------------------|---|---|----------------|---|------------------|------------------|
| 资产        |                  |   |   |                  |   |   |                |   | 250.00           | 2,250.00         |
| 应收证券清算款   | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 应收利息      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 18,292,856.93    | 18,292,856.93    |
| 应收股利      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 应收申购款     | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 2,435,169.19     | 2,435,169.19     |
| 其他资产      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 资产总计      | 1,464,890,571.32 | - | - | 1,826,365,630.53 | - | - | 635,124,547.03 | - | 1,253,797,674.23 | 5,180,178,423.11 |
| 负债        |                  |   |   |                  |   |   |                |   |                  |                  |
| 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   | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 20,487,257.64    | 20,487,257.64    |
| 应付赎回款     | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 20,086,713.38    | 20,086,713.38    |
| 应付管理人报酬   | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 6,275,319.98     | 6,275,319.98     |
| 应付托管费     | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 1,045,886.64     | 1,045,886.64     |
| 应付销售服务费   | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 应付交易费用    | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 392,380.04       | 392,380.04       |
| 应付税费      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 应付利息      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 应付利润      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | -                | -                |
| 其他负债      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 137,860.72       | 137,860.72       |
| 负债总计      | -                | - | - | -                | - | - | -              | - | 48,425,418.40    | 48,425,418.40    |
| 利率敏感度缺口   | 1,464,890,571.32 | - | - | 1,826,365,630.53 | - | - | 635,124,547.03 | - | 1,205,372,255.83 | 5,131,753,004.71 |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |
|----|--------------------|---------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                    | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日          |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加 9,369,553.18                 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少 9,369,553.18                 |

注：本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满半年，无上年度末数据。

**6.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 2.59%，债券投资比例为基金资产净值的 47.97%，无衍生金融资产。于 2015 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

**6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |              |
|---------------|------------------------|--------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 133,067,398.11         | 2.59         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -            |
| 交易性金融资产—债券投资  | 2,461,490,177.56       | 47.97        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -            |

|             |                  |       |
|-------------|------------------|-------|
| 衍生金融资产—权证投资 | -                | -     |
| 合计          | 2,594,557,575.67 | 50.56 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金于 2015 年 4 月 8 日成立，截至本报告期末本基金成立不满六个月。

本报告期末，本基金尚处于建仓期，因此未以基金与业绩基准之间的相关性进行其他价格风险的敏感性分析。

上年度末（2014 年 12 月 31 日），本基金未成立。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 133,067,398.11   | 2.57         |
|    | 其中：股票             | 133,067,398.11   | 2.57         |
| 2  | 固定收益投资            | 2,461,490,177.56 | 47.52        |
|    | 其中：债券             | 2,461,490,177.56 | 47.52        |
|    | 资产支持证券            | -                | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -                | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -                | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 1,100,002,250.00 | 21.23        |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,464,783,214.00 | 28.28        |
| 7  | 其他各项资产            | 20,835,383.44    | 0.40         |
| 8  | 合计                | 5,180,178,423.11 | 100.00       |

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|------------------|----------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 17,308,599.65  | 0.34             |
| B  | 采矿业              | 1,635,059.25   | 0.03             |
| C  | 制造业              | 65,393,330.95  | 1.27             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -                |
| E  | 建筑业              | 517,786.92     | 0.01             |
| F  | 批发和零售业           | -              | -                |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 11,851,422.22  | 0.23             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 21,790,040.04  | 0.42             |
| J  | 金融业              | -              | -                |
| K  | 房地产业             | -              | -                |
| L  | 租赁和商务服务业         | 673,691.40     | 0.01             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 823,611.68     | 0.02             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -                |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -                |
| P  | 教育               | -              | -                |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -                |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 13,073,856.00  | 0.25             |
| S  | 综合               | -              | -                |
|    | 合计               | 133,067,398.11 | 2.59             |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)     | 公允价值          | 占基金资产净<br>值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 002156 | 通富微电 | 1,264,500 | 23,595,570.00 | 0.46             |
| 2  | 600598 | 北大荒  | 992,000   | 16,824,320.00 | 0.33             |
| 3  | 300336 | 新文化  | 548,400   | 13,073,856.00 | 0.25             |
| 4  | 000555 | 神州信息 | 144,200   | 10,786,160.00 | 0.21             |
| 5  | 600009 | 上海机场 | 338,000   | 10,714,600.00 | 0.21             |
| 6  | 300036 | 超图软件 | 231,500   | 8,491,420.00  | 0.17             |
| 7  | 300296 | 利亚德  | 360,000   | 6,696,000.00  | 0.13             |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8  | 300205 | 天喻信息 | 200,000 | 6,030,000.00 | 0.12 |
| 9  | 300408 | 三环集团 | 140,000 | 4,880,400.00 | 0.10 |
| 10 | 300476 | 胜宏科技 | 46,973  | 2,235,914.80 | 0.04 |
| 11 | 601968 | 宝钢包装 | 157,140 | 2,192,103.00 | 0.04 |
| 12 | 300473 | 德尔股份 | 28,645  | 1,901,455.10 | 0.04 |
| 13 | 603616 | 韩建河山 | 50,000  | 1,717,000.00 | 0.03 |
| 14 | 603979 | 金诚信  | 66,063  | 1,635,059.25 | 0.03 |
| 15 | 002765 | 蓝黛传动 | 66,054  | 1,572,745.74 | 0.03 |
| 16 | 300475 | 聚隆科技 | 49,019  | 1,511,255.77 | 0.03 |
| 17 | 300470 | 日机密封 | 15,880  | 1,510,982.00 | 0.03 |
| 18 | 300488 | 恒锋工具 | 71,341  | 1,434,667.51 | 0.03 |
| 19 | 002762 | 金发拉比 | 16,999  | 1,410,917.00 | 0.03 |
| 20 | 002767 | 先锋电子 | 30,140  | 1,309,884.40 | 0.03 |
| 21 | 300465 | 高伟达  | 14,000  | 1,278,200.00 | 0.02 |
| 22 | 300485 | 赛升药业 | 17,372  | 1,164,097.72 | 0.02 |
| 23 | 603589 | 口子窖  | 45,168  | 1,144,557.12 | 0.02 |
| 24 | 300467 | 迅游科技 | 3,726   | 1,107,739.80 | 0.02 |
| 25 | 603066 | 音飞储存 | 22,500  | 911,475.00   | 0.02 |
| 26 | 002766 | 索菱股份 | 25,350  | 862,153.50   | 0.02 |
| 27 | 002776 | 柏堡龙  | 20,296  | 823,611.68   | 0.02 |
| 28 | 002760 | 凤形股份 | 22,488  | 813,615.84   | 0.02 |
| 29 | 300472 | 新元科技 | 13,626  | 629,384.94   | 0.01 |
| 30 | 002775 | 文科园林 | 19,306  | 517,786.92   | 0.01 |
| 31 | 002772 | 众兴菌业 | 21,381  | 484,279.65   | 0.01 |
| 32 | 300479 | 神思电子 | 9,600   | 434,688.00   | 0.01 |
| 33 | 002773 | 康弘药业 | 17,338  | 411,430.74   | 0.01 |
| 34 | 002770 | 科迪乳业 | 40,555  | 399,872.30   | 0.01 |
| 35 | 002768 | 国恩股份 | 14,405  | 362,429.80   | 0.01 |
| 36 | 002769 | 普路通  | 7,710   | 347,952.30   | 0.01 |
| 37 | 603117 | 万林股份 | 34,690  | 325,739.10   | 0.01 |
| 38 | 603223 | 恒通股份 | 18,826  | 225,347.22   | 0.00 |
| 39 | 300486 | 东杰智能 | 16,092  | 207,104.04   | 0.00 |
| 40 | 300482 | 万孚生物 | 7,942   | 182,983.68   | 0.00 |
| 41 | 300487 | 蓝晓科技 | 10,700  | 158,681.00   | 0.00 |
| 42 | 300483 | 沃施股份 | 9,356   | 153,438.40   | 0.00 |
| 43 | 300481 | 濮阳惠成 | 11,296  | 148,542.40   | 0.00 |
| 44 | 603838 | 四通股份 | 18,119  | 140,059.87   | 0.00 |
| 45 | 300489 | 中飞股份 | 7,319   | 128,521.64   | 0.00 |
| 46 | 002771 | 真视通  | 6,251   | 126,520.24   | 0.00 |
| 47 | 300480 | 光力科技 | 7,263   | 52,874.64    | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600000 | 浦发银行 | 21,946,657.33 | 0.43            |
| 2  | 601009 | 南京银行 | 21,555,692.33 | 0.42            |
| 3  | 601818 | 光大银行 | 21,520,987.61 | 0.42            |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 21,338,632.24 | 0.42            |
| 5  | 002156 | 通富微电 | 20,484,900.00 | 0.40            |
| 6  | 600598 | 北大荒  | 18,989,857.50 | 0.37            |
| 7  | 300336 | 新文化  | 15,466,723.80 | 0.30            |
| 8  | 300253 | 卫宁软件 | 14,542,028.01 | 0.28            |
| 9  | 300408 | 三环集团 | 13,869,501.38 | 0.27            |
| 10 | 300352 | 北信源  | 13,585,103.00 | 0.26            |
| 11 | 300296 | 利亚德  | 13,514,798.95 | 0.26            |
| 12 | 300205 | 天喻信息 | 12,938,082.80 | 0.25            |
| 13 | 300036 | 超图软件 | 10,307,816.85 | 0.20            |
| 14 | 000555 | 神州信息 | 10,290,980.00 | 0.20            |
| 15 | 600009 | 上海机场 | 10,287,660.00 | 0.20            |
| 16 | 300488 | 恒锋工具 | 1,434,667.51  | 0.03            |
| 17 | 603979 | 金诚信  | 1,135,622.97  | 0.02            |
| 18 | 300473 | 德尔股份 | 823,830.20    | 0.02            |
| 19 | 603989 | 艾华集团 | 762,464.62    | 0.01            |
| 20 | 300476 | 胜宏科技 | 738,885.29    | 0.01            |

## 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 601009 | 南京银行 | 23,479,499.08 | 0.46            |
| 2  | 601818 | 光大银行 | 22,167,724.98 | 0.43            |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 22,101,203.00 | 0.43            |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 20,657,753.58 | 0.40            |
| 5  | 300253 | 卫宁软件 | 13,973,730.00 | 0.27            |
| 6  | 300352 | 北信源  | 13,891,944.00 | 0.27            |
| 7  | 300408 | 三环集团 | 8,196,624.40  | 0.16            |
| 8  | 300296 | 利亚德  | 7,096,305.75  | 0.14            |
| 9  | 300205 | 天喻信息 | 6,740,819.84  | 0.13            |
| 10 | 603198 | 迎驾贡酒 | 3,129,230.00  | 0.06            |
| 11 | 603989 | 艾华集团 | 2,440,391.27  | 0.05            |
| 12 | 603669 | 灵康药业 | 2,289,486.23  | 0.04            |
| 13 | 603300 | 华铁科技 | 1,447,756.72  | 0.03            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 300468 | 四方精创 | 1,440,587.00 | 0.03 |
| 15 | 603968 | 醋化股份 | 1,429,003.52 | 0.03 |
| 16 | 002757 | 南兴装备 | 1,389,676.20 | 0.03 |
| 17 | 603568 | 伟明环保 | 1,269,357.15 | 0.02 |
| 18 | 603901 | 永创智能 | 1,244,275.76 | 0.02 |
| 19 | 002759 | 天际股份 | 1,150,532.66 | 0.02 |
| 20 | 603108 | 润达医疗 | 1,073,898.00 | 0.02 |

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 258,619,021.12 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 158,179,402.02 |

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 150,700,000.00   | 2.94         |
|    | 其中：政策性金融债 | 150,700,000.00   | 2.94         |
| 4  | 企业债券      | 584,793,029.54   | 11.40        |
| 5  | 企业短期融资券   | 1,421,241,000.00 | 27.70        |
| 6  | 中期票据      | 302,512,000.00   | 5.89         |
| 7  | 可转债       | 2,244,148.02     | 0.04         |
| 8  | 其他        | -                | -            |
| 9  | 合计        | 2,461,490,177.56 | 47.97        |

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

|   |           |                    |           |                |      |
|---|-----------|--------------------|-----------|----------------|------|
| 1 | 150411    | 15 农发 11           | 1,000,000 | 100,430,000.00 | 1.96 |
| 2 | 122384    | 15 中信 01           | 1,000,000 | 99,989,917.81  | 1.95 |
| 3 | 122388    | 15 华泰 D1           | 1,000,000 | 99,981,589.04  | 1.95 |
| 4 | 101551038 | 15 联通<br>MTN001    | 1,000,000 | 99,800,000.00  | 1.94 |
| 5 | 011599078 | 15 北方水<br>泥 SCP001 | 700,000   | 69,930,000.00  | 1.36 |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除 15 中信 01、15 华泰 D1 和 15 北方水泥 SCP001 外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的

情形。

15 中信 01（122384）的发行主体中信证券股份有限公司于 2015 年 1 月 19 日发布公告称，因存在为到期融资融券合约展期的问题被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。

15 华泰 D1（122388）的发行主体华泰证券股份有限公司于 2014 年 9 月 6 日发布公告称，收到中国证监会关于不同计划之间间接违规进行债券买卖交易的《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定（[2014]62 号）》，该决定书同时提及中国人民银行南京分行于 2014 年 6 月就此事项对华泰证券进行了行政处罚，但华泰证券并未及时向监管部门报告。

15 北方水泥 SCP001（011599078）的发行主体北方水泥有限公司于 2014 年 9 月 11 日发布公告称，收到吉林省物价局关于价格垄断违法行为的《行政处罚决定书》（吉省价处【2014】8 号）。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 107,357.32    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 18,292,856.93 |
| 5  | 应收申购款   | 2,435,169.19  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 20,835,383.44 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构            |            |                  |            |
|----------|---------------|------------------|------------|------------------|------------|
|          |               | 机构投资者            |            | 个人投资者            |            |
|          |               | 持有份额             | 占总份额<br>比例 | 持有份额             | 占总份额<br>比例 |
| 6,638    | 769,149.95    | 3,384,565,961.82 | 66.29%     | 1,721,051,421.00 | 33.71%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                  |
|-------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2015 年 4 月 8 日）基金份额总额 | 619,398,446.67   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额         | 4,849,376,529.61 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额       | 363,157,593.46   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额        | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                  | 5,105,617,382.82 |

注：1.本基金基金合同于 2015 年 4 月 8 日生效。

2.总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2015 年 6 月 6 日, 基金管理人发布关于《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起谭晓雨女士担任我司总经理一职。公司董事长虞启斌先生不再代为履行总经理职责。上述事项已经 2015 年 4 月 7 日召开的国联安基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议审议通过。

2. 2015 年 6 月 12 日, 基金管理人发布《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》。增聘李广瑜先生担任本基金的基金经理。

3. 2015 年 6 月 23 日, 基金管理人发布《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》。周平先生不再担任本基金的基金经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|--------------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|              |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2      | 398,818,823.82 | 100.00%      | 358,506.74 | 100.00%    | -  |

注: 1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构, 选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用, 选用标准为:

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

#### (2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

#### 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本基金的交易单元均为本期新增。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易           |                  | 回购交易             |                  | 权证交易 |                  |
|--------------|----------------|------------------|------------------|------------------|------|------------------|
|              | 成交金额           | 占当期债券成交总额的<br>比例 | 成交金额             | 占当期回购成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总<br>额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 153,446,102.98 | 100.00%          | 6,303,500,000.00 | 100.00%          | -    | -                |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式                | 法定披露日期     |
|----|---|-----------------------|------------|
| 1  | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-03-27 |
| 2  | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-03-27 |
| 3  | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金合同摘要                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-03-27 |
| 4  | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金合同                                | 公司网站                  | 2015-03-27 |
| 5  | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金托管协议                                | 公司网站                  | 2015-03-27 |
| 6  | 国联安基金管理有限公司关于调整网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-03-31 |
| 7  | 国联安基金管理有限公司关于国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金增加中国建设银行股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-03-31 |
| 8  | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-04-03 |
| 9  | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长电科技、阳光电源、金新农、艾派克、鼎立股份估值调整的公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-04-09 |
| 10 | 国联安基金管理有限公司关于国联安睿祺灵活配置混合证券投资基金基金合同生效公告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-04-09 |
| 11 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持招商地产、招商银行估值调整的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-04-10 |
| 12 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持银之杰估值调整的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-04-11 |
| 13 | 国联安基金管理有限公司关于国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站 | 2015-04-13 |

|    |  |                            |            |
|----|--|----------------------------|------------|
| 14 | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务的公告                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-15 |
| 15 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华昌达、佳讯飞鸿、三诺生物、红日药业估值调整的公告               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-15 |
| 16 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金参加国泰君安证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-16 |
| 17 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金参加海通证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-16 |
| 18 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金参加交通银行股份有限公司相关费率优惠活动的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-16 |
| 19 | 国联安基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投及费率优惠的公告     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-04-21 |
| 20 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-23 |
| 21 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宝鹰股份估值调整的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-23 |
| 22 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三钢闽光和金达威估值调整的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-25 |
| 23 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持蓝丰生化估值调整的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-25 |
| 24 | 国联安基金管理有限公司关于国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金增加代销机构的公告                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-04-30 |
| 25 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告                 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-04-30 |
| 26 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持新开普估值调整的公告                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-04 |
| 27 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持江西长运和中源协和估值调整的公告                        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-09 |
| 28 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华平股份估值调整的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-09 |
| 29 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金增加华宝证券有限责任公司为代销机构的公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-13 |
| 30 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持  | 中国证券报、上海证券                 | 2015-05-13 |

|    |  |                            |            |
|----|--|----------------------------|------------|
|    | 昆仑万维、国脉科技、华西能源估值调整的公告                                      | 报、证券时报、公司网站                |            |
| 31 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持雷曼光电、远望谷、海陆重工、海南瑞泽估值调整的公告               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-14 |
| 32 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持一心堂估值调整的公告                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-15 |
| 33 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持延华智能（002178）估值调整的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-20 |
| 34 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告                               | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-21 |
| 35 | 国联安基金管理有限公司关于调整网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-21 |
| 36 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持奥飞动漫、科陆电子估值调整的公告                        | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-22 |
| 37 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中国南车等股票估值调整的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-23 |
| 38 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持金螳螂和西部建设估值调整的公告                         | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-23 |
| 39 | 国联安基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投、转换及费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-05-26 |
| 40 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持北新建材、兆驰股份等股票估值调整的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-27 |
| 41 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持首开股份等股票估值调整的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-28 |
| 42 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三安光电股票估值调整的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-30 |
| 43 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持腾邦国际等股票估值调整的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-05-30 |
| 44 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海钢联、探路者、新华医疗股票估值调整的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-03 |
| 45 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持电广传媒等股票估值调整的公告                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-04 |
| 46 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浩宁达股票估值调整的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-05 |
| 47 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持海亮股份股票估值调整的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-06 |
| 48 | 国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告                                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-06-06 |
| 49 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浦发银行股票估值调整的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-10 |

|    |   |                            |            |
|----|---|----------------------------|------------|
| 50 | 国联安基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投、转换及费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-06-10 |
| 51 | 国联安基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及开通定投、转换及费率优惠的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-06-10 |
| 52 | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-12 |
| 53 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-13 |
| 54 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持三泰控股等股票估值调整的公告                           | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-18 |
| 55 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持仁和药业股票估值调整的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-19 |
| 56 | 国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-23 |
| 57 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告                                | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-23 |
| 58 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长荣股份、华东医药股票估值调整的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站      | 2015-06-27 |
| 59 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2015-06-30 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 11.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

### 11.3 查阅方式

网址：[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com) 或 [www.vip-funds.com](http://www.vip-funds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日