国联安德盛增利债券证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安增利债券		
基金主代码	253020		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2009年3月11日		
报告期末基金份额总额	2,947,802,473.68份		
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。		
投资策略	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、股票市场各自风险收益特征及其演变趋势的综合分析,比较,首先采用类属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	本基金业绩比较基准为中债综合指数。		
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。		
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		
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	2,660,363,782.47份	287,438,691.21份	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)	
	国联安增利债券A	国联安增利债券B
1.本期已实现收益	35,737,191.86	3,500,188.29
2.本期利润	41,050,349.78	4,457,687.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0217	0.0217
4.期末基金资产净值	3,496,974,951.69	373,967,229.87
5.期末基金份额净值	1.314	1.301

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

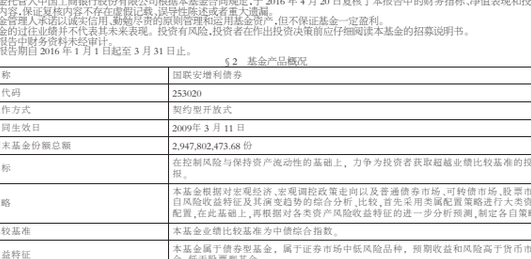
1、国联安增利债券A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.70%	0.06%	0.31%	0.07%	1.39%	-0.01%

注:1、本基金的业绩比较基准自2015年9月16日起由原来的"中信标普全债指数"变更为"中债综合指数";
2、本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券投资基金
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3月11日至2016年3月31日)



注:1、本基金的业绩比较基准自2015年9月16日起由原来的"中信标普全债指数"变更为"中债综合指数";
2、本基金基金合同于2009年3月11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。

2. 国联安增利债券B:

注:1、本基金的业绩比较基准自2015年9月16日起由原来的"中信标普全债指数"变更为"中债综合指数";
2、本基金基金合同于2009年3月11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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李广瑜	本基金基金经理,兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理,国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安保本混合型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,国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2013-11-14	2016-03-15	7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月在陆里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月至2016年3月担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理。2013年12月至2016年3月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月至2015年12月兼任国联安中小盘价用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2015年6月至2016年3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6月至2016年3月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月至2016年3月兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。2016年2月至3月兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金和国联安鑫稳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,兼任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)基金经理,国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理,国联安稳健增利债券证券投资基金基金经理,国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫润灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安稳保本混合型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监。	2015-11-27	-	15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月不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月起任国联安双佳信用债券型证券投资基金(LOF)的基金经理。2014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,2014年6月起兼任国联安稳健增长成长混合型证券投资基金基金经理。2015年3月起兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年4月起兼任国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月起兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年6月起兼任国联安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年11月起兼任国联安鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安稳健增利债券证券投资基金基金经理。2016年2月起兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金,国联安鑫稳灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年3月起兼任国联安稳保本混合型证券投资基金基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《国联安德盛增利债券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 公平交易专项说明

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》,并通过公平交易制度的执行,在投资决策、交易执行、投资监控、交易分析、业绩评估等投资管理活动中,公平地对待所管理的投资组合,保证投资决策的独立性、交易执行的及时性、投资监控的有效性、交易分析的客观性、业绩评估的准确性。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年1季度,债市走出了明显的结构性行情。1月份的天量信贷让市场对于经济是否会被"稳增长"左右摇摆。既不敢参与供给测改革的周期性行业,也对利率债持有谨慎态度。加上配置资金持续涌入,城投债成了纠结中的最优且无奈的选择。城投债的信用利差也随之一再收窄。本组合也因此收益颇丰。站在现在的时点上,经济增长内生动力依然存疑,这意味着货币政策依然有进一步放松的必要,只不过央行会更加注意宽松的预期管理;通胀虽然短期因为食品因素存在冲高可能,但这季节性因素的主导也意味着短期存在见顶的可能;安全性资产的信用利差一再被压缩使得其合理的价值需要被客观看待。在此情况下,我们认为在保证组合信用风险无忧的前提下,需要将组合配置逐步均衡化。即,利率与信用的均衡,短期和长期的均衡。并保持适当的杠杆,在资金面波动日渐频繁的情况下灵活操作。

本基金报告期内主要是清除组合里低资质债券,提升组合的整体资质,保持适当杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安增利债券A的份额净值增长率为1.70%,同期业绩比较基准收益率为0.31%;国联安增利债券B的份额净值增长率为1.64%,同期业绩比较基准收益率为0.31%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	4,699,374,409.81	94.89
	其中:债券	4,699,374,409.81	94.89
	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	-	-
	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	53,779,784.35	1.09
7	其他各项资产	199,311,844.27	4.02
8	合计	4,952,466,038.43	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	868,793,000.00	22.44
	其中:政策性金融债	868,793,000.00	22.44
4	企业债券	2,275,586,436.20	58.79
5	企业短期融资券	350,010,000.00	9.04
6	中期票据	1,204,316,000.00	31.11
7	可转债(可交换债)	668,973.61	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,699,374,409.81	121.40

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150405	15农发05	1,300,000	135,551,000.00	3.50
2	150209	15国开09	1,200,000	126,504,000.00	3.27
3	112196	13苏宁债	958,670	103,536,360.00	2.67
4	112138	12苏宁01	999,995	103,519,482.40	2.67
5	150419	15农发19	900,000	90,081,000.00	2.33

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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.

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证.

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,002.12
2	应收证券清算款	111,809,408.98
3	应收股利	-
4	应收利息	87,117,055.22
5	应收申购款	340,377.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	199,311,844.27

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国联安增利债券A	国联安增利债券B
本报告期期初基金份额总额	1,753,544,760.26	154,592,051.25
报告期基金总申购份额	1,078,638,319.92	140,145,380.32
减:报告期基金总赎回份额	171,819,297.71	7,298,740.36
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,660,363,782.47	287,438,691.21

注: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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安德盛增利债券证券投资基金(现国联安德盛优势混合型证券投资基金)发行及募集的文件
2、《国联安德盛增利债券证券投资基金基金合同》
3、《国联安德盛增利债券证券投资基金托管协议》
4、《国联安德盛增利债券证券投资基金招募说明书》
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

8.2 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

8.3 查阅方式

网址:www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一六年四月二十二日

国联安货币市场证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安货币	
基金主代码	253050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月26日	
报告期末基金份额总额	20,071,443,362.10份	
投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动式管理,定性分析与量化分析相结合,力争为投资者提供稳定的收益。	
投资策略	本基金采取积极的投资策略,自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析,形成对短期利率变化方向的预测,在此基础之上,确定组合久期和类别资产配置比例,把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择,具体包括以下策略: 1、利率预期策略 2、收益率曲线策略 3、类属配置策略 4、现金流管理策略 5、套利策略 6、个券选择策略	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型基金与股票型基金。	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国联安货币A	国联安货币B
下属分级基金的交易代码	253050	253051
报告期末下属分级基金的份额总额	47,305,602.07份	20,024,137,760.03份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)	
	国联安货币A	国联安货币B
1.本期已实现收益	382,468.73	77,597,111.08
2.本期利润	382,468.73	77,597,111.08
3.期末基金资产净值	47,305,602.07	20,024,137,760.03

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;
2、上述基金业绩指标不包括持有人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 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、国联安货币A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6375%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.3009%	0.0020%

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;
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、国联安货币B:

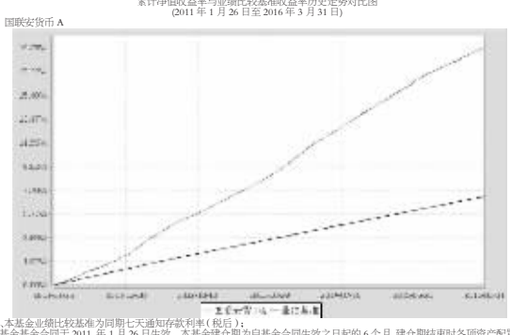
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6980%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.3614%	0.0020%

注:1、本基金收益分配按日结转份额;
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累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

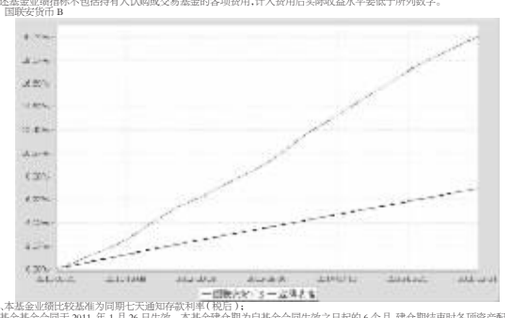
国联安货币市场证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年1月26日至2016年3月31日)

1、 国联安货币A



注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);
2、本基金基金合同于2011年1月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的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。

2、 国联安货币B



注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);
2、本基金基金合同于2011年1月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛琳	本基金基金经理,兼任国联安鑫采灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2012-07-11	2016-01-15	10年(自2006年起)	薛琳女士,管理学学士,2006年3月至2006年12月在上海任同金融研究中心公司担任项目管理工作。2006年12月至2008年6月在上海国利货币有限公司担任债券交易员。2008年6月至2010年6月在上海长江养老保险股份有限公司担任债券交易员。自2010年6月起,加盟国联安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理职务。2012年7月至2016年1月担任国联安货币市场证券投资基金基金经理。2012年12月起至2015年11月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月起兼任国联安鑫采灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年3月起兼任国联安鑫悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
侯慧娴	本基金基金经理,兼任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理,国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015-12-25	-	9年(自2007年)	侯慧娴女士,理学硕士,2006年3月至2006年7月在国泰君安证券研究所从事国内债券市场数据分析与处理;2006年7月至2008年10月在丰田软件(上海)有限公司从事债券分析;2009年12月至2012年9月在国信证券股份有限公司担任研究所从事债券和固定收益分析;2012年9月至2015年6月在德邻基金管理有限公司固定收益部从事研究和管理工作。期间曾担任基金经理和固定收益部副总监。2015年6月加入国联安基金管理有限公司,2015年12月起任国联安睿祺灵活配置混合型证券投资基金基金经理。国联安货币市场证券投资基金基金经理。2016年3月起兼任国联安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《国联安货币市场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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年1季度,国内宏观经济基本面呈短期改善迹象,通胀上行但绝对水平较低,人民币汇率贬值预期依然存在,贬值压力依然较大,央行货币政策放松节奏有所调整,加强公开市场频率操作,同时开始在一季度实行MPA宏观审慎监管,货币市场资金面呈现由于监管和央行对冲不及时导致的阶段性时点性资金紧张特征,但也出现阶段性流动性充裕特征。2016年2月1日起新的货币基金管理办法正式实施,我们认为监管部门进一步强调了基金的风险管理,包括流动性风险、利率风险、信用风险等。在本基金的管理中,我们顺应监管思路,高度重视基金的风险管理,1季度在规模稳步增加的基础上,均衡配置了短融、存款和存单,同时在时点性资金紧张时重点配置了收益率较高的逆回购资产,在控制风险的基础上通过积极的主动管理为持有人贡献超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安货币A净值收益率为0.6375%,同期业绩比较基准增长率为0.3366%。国联安货币B净值收益率为0.6980%,同期业绩比较基准增长率为0.3366%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,266,723,600.81	46.15
	其中:债券	9,266,723,600.81	46.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,990,302,165.45	14.89
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,727,293,860.01	38.49
4	其他资产	94,039,635.38	0.47
5	合计	20,078,359,261.65	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.62	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

注:根据本基金基金合同规定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使不符合规定的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	18.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	22.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	12.61	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.57	-

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	830,733,625.46	4.14
	其中:政策性金融债	830,733,625.46	4.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,443,727,679.94	22.14
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,992,262,295.41	19.89
8	其他	-	-
9	合计	9,266,723,600.81	46.17
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150419	15农发19	3,600,000	360,414,985.55	1.80
2	111691159	16邯郸银行CD025	3,200,000	318,380,710.63	1.59
3	111691538	16贵州花溪农商行CD005	3,000,000	299,690,672.77	1.49
4	111617020	16光大CD020	3,000,000	298,811,427.55	1.49
5	130233	13国开33	2,000,000	200,231,523.45	1.00
6	011599800	15山钢SCP007	2,000,000	200,018,221.84	1.00
7	011699466	16鲁能源SCP002	2,000,000	199,919,432.28	1.00
8	111691993	16厦门农商行CD014	2,000,000	199,557,127.32	0.99
9	111691148	16宁波银行CD027	2,000,000	199,032,282.24	0.99
10	111593074	15西安银行CD036	2,000,000	198,676,634.77	0.99

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.13%
报告期内偏离度的最低值	0.05%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.09%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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.

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	93,775,105.30
4	应收申购款	264,530.08
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	94,039,635.38

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国联安货币A	国联安货币B
本报告期期初基金份额总额	86,418,359.35	10,120,981,676.89
报告期基金总申购份额	71,713,470.78	22,370,243,443.58
报告期基金总赎回份额	110,826,228.06	12,467,087,360.44
报告期基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	47,305,602.07	20,024,137,760.03

注:总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额;总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易