

国联安中证医药100指数证券投资基金

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：交通银行股份有限公司
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、基金托管人及基金销售机构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。

基金管理人、基金托管人及基金销售机构根据本基金合同规定，于2016年4月21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，保证基金不存在虚假记载、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预示其未来业绩表现，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	国联安中证医药100指数
基金代码	000009
交易代码	000009
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年8月21日
报告期末基金份额总额	185,956,944.39份
投资目标	本基金投资于中证医药100指数成份股及其权重相仿的证券，进行被动式指数化投资，跟踪业绩比较基准的表现，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度不超过0.35%，年化跟踪误差不得超过4%，为投资者提供一只投资中证医药100指数的有效工具，以分享中远期经济中长期增长的确定性收益。
投资策略	本基金采用完全复制的指数化的方法，进行被动式指数化投资，跟踪业绩比较基准的表现，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度不超过0.35%，年化跟踪误差不得超过4%，以实现对中证医药100指数的有效跟踪。本基金在追求跟踪偏离度不超过0.35%、年化跟踪误差不得超过4%的前提下，将采用以下投资策略：1、复制法：本基金将采用完全复制法，按照中证医药100指数的成份股及其权重构建投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。2、替代法：当因某些成份股流动性较差或因法律法规的限制，本基金管理人有权对投资组合管理进行适当变通和调整，并将在合理范围内进行替代，以期达到跟踪标的指数的投资目的。
业绩比较基准	95%×中证医药100指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为被动式指数基金，具有较高风险、较高预期收益特征，其风险和预期收益均高于市场基金和债券型基金。

基金管理人：国联安基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

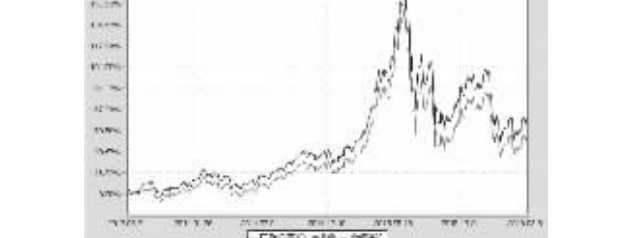
3.1 主要财务指标		单位：人民币元				
主要财务指标	报告期 (2016年1月1日至2016年3月31日)					
1.本期已实现收益	-2,406,044.03					
2.本期利润	-54,124,576.53					
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2906					
4.期末基金资产净值	274,425,465.30					
5.期末基金份额净值	1.476					
注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含各资产估值变动及公允价值变动产生的损益。2.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下列数字。						
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的比较						
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益	业绩比较基准标准差	①-③	②-④
过去三个月	-16.50%	2.40%	-17.35%	2.49%	0.79%	-0.03%

注：1.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下列数字。

3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

国联安中证医药100指数证券投资基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年8月21日至2016年3月31日)



注：1.本基金净值比较基准为：95%×中证医药100指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

2.本基金基金合同于2015年8月21日生效，本基金基金合同自基金合同生效之日起每6个月，建仓期结束各项资产配置符合合同约定，1.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下列数字。

§4 基金管理人

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
曹洁	本基金基金管理人、国联安基金管理有限公司副总经理、国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理	2015-05-29	-	6年（自2001年起）	曹洁，金融学硕士，工商管理硕士，上海交通大学安泰管理学院金融工程硕士，先后担任华泰证券研究所研究员、国联安基金管理有限公司研究员、国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。2015年5月29日起担任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。4.00 基金合同
注：1.基金管理人经理日报和季报披露日期为公司对外公告之日；					
2.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
3.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
4.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
5.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
6.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
7.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
8.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
9.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
10.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
11.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
12.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
13.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
14.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
15.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
16.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
17.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
18.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
19.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
20.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
21.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
22.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
23.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
24.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
25.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
26.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
27.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
28.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
29.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
30.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
31.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
32.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
33.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
34.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
35.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
36.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
37.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
38.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
39.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
40.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
41.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
42.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
43.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
44.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
45.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
46.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
47.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
48.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
49.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
50.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
51.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
52.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
53.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
54.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
55.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
56.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
57.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
58.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
59.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
60.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
61.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
62.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
63.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
64.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
65.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
66.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
67.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
68.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
69.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
70.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
71.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
72.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
73.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
74.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
75.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
76.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
77.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
78.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
79.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
80.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
81.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
82.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
83.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
84.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
85.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
86.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
87.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
88.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
89.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
90.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
91.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
92.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
93.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
94.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
95.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
96.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
97.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
98.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
99.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					
100.基金经理的任职和免职日期为本基金管理人公告之日；					

注：1.本基金净值比较基准为：95%×中证医药100指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

2.本基金基金合同于2015年8月21日生效，本基金基金合同自基金合同生效之日起每6个月，建仓期结束各项资产配置符合合同约定，1.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下列数字。

§4 基金管理人

1	权益投资	253,142,416.60	91.97
	其中:股票	253,142,416.60	91.97
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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:买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行承兑汇票及备付金合计	21,876,332.28	7.95
7	其他资产合计	2,127,571.21	0.80