

国联安科技动力股票型证券投资基金

2016 年第 1 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 26 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国联安科技动力股票 |
| 基金主代码 | 001956 |
| 交易代码 | 001956 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 1 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 252,810,701.53 份 |
| 投资目标 | 精选以科学技术为动力、具有较高成长性及盈利质量的行业及个股，在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 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、资产支持证券、股指期货、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）。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型证券投资基金，属于高预期风险、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混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§ 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 26 日（基金合同生效日）-2016 年 3 月 31 日) |
| 1. 本期已实现收益 | 96,271.60 |
| 2. 本期利润 | 6,180,552.16 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0244 |
| 4. 期末基金资产净值 | 258,991,253.69 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.024 |

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

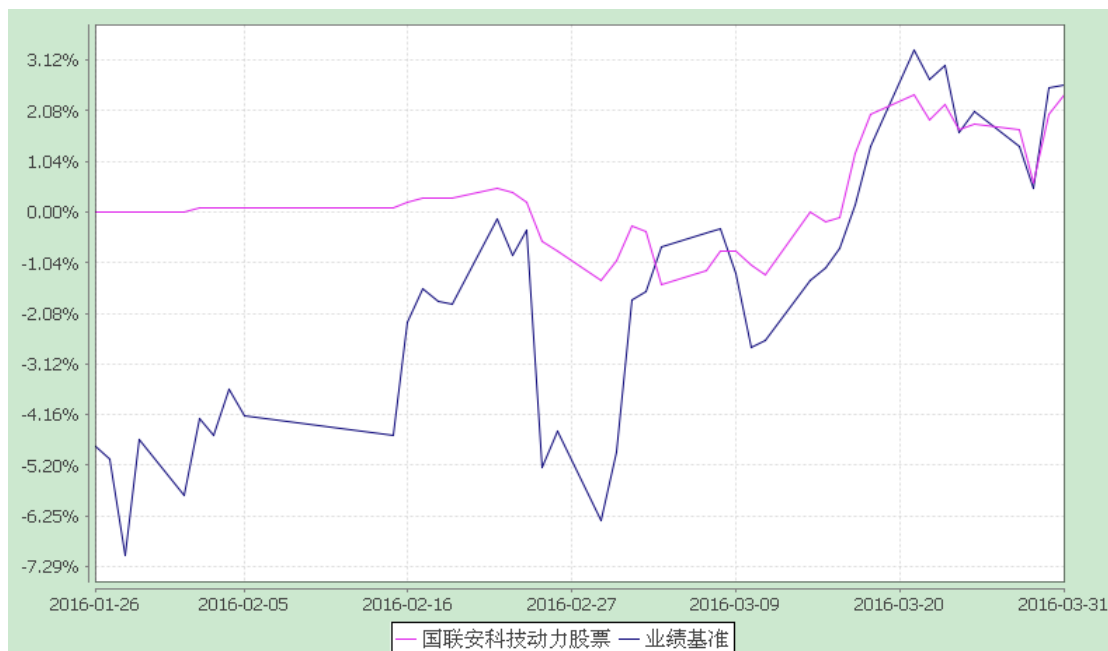
| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

| | 率① | 率标准差 ② | 基准收益 率③ | 基准收益 率标准差 ④ | | |
|--|-------|-----------|------------|-------------------|--------|--------|
| 自基金合同 生效之日 (2016 年 1 月 26 日) 起至本报告 期末 | 2.40% | 0.52% | 2.60% | 1.63% | -0.20% | -1.11% |

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国联安科技动力股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016 年 1 月 26 日至 2016 年 3 月 31 日)



- 注：1、本基金业绩比较基准为：沪深300指数*80%+上证国债指数*20%；
2、本基金基金合同于2016年1月26日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
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 | | |
| 潘明 | 本基金基金经理、兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理、国联安主题驱动混合型证券投资基金基金经理。 | 2016-01-26 | - | 7 年（自 2009 年起） | 潘明, 硕士研究生, 1996 年 6 月至 1998 年 6 月在计算机科学公司担任咨询师; 1998 年 8 月至 2005 年 5 月在摩托罗拉公司担任高级行政工程师; 2003 年 1 月至 2003 年 12 月在扎克斯投资管理公司担任投资分析师; 2004 年 4 月至 2005 年 5 月在短剑投资公司担任执行董事; 2005 年 5 月至 2009 年 7 月在指导资本公司担任基金经理兼大宗商品研究总监; 2009 年 8 月至 2010 年 3 月在海通证券股份有限公司担任投资经理; 2010 年 1 月至 2013 年 1 月在 GCS 母基金公司、GCS 有限公司、GCS 有限责任合伙企业担任独立董事; 2010 年 3 月至 2012 年 10 月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理助理; 2012 年 10 月至 2013 年 12 月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理。2013 年 12 月起加入国联安基金管理有限公司, 担任基金经理助理。2014 年 2 月起担任国联安优选行业混合型 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 证券投资基金基金经理。 2015 年 4 月起兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金。2015 年 4 月起兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金基金经理。 2016 年 1 月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

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》、《国联安科技动力股票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 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

本基金的投资策略很大程度上聚焦计算机行业。计算机行业在 2016 年一季度呈现先抑后扬的行情表现，行业在一二月份的深跌后在三月份反弹较多。市场年初以来的下跌一定程度上消化了 2015 年的上涨带来的整体行业高估值。一二月份的下跌为本基金的建仓带来了比较好的环境。本基金坚持越跌越买的建仓期操作策略，在一季度下跌的不利市场环境中获得了绝对收益。

与一两年前的市场相比，更多的投资者不是在传统周期股和科技成长股之间博弈，而是在科技成长行业内博弈，这增加了本基金在计算机等 TMT 行业中获取超额收益的难度。TMT 投资的羊群越来越拥挤，但本基金管理人仍将一如既往的坚持独立思考、深耕行业，只有这样才能更前瞻、更精准的投资行业并且规避不理性的羊群行为。

在一季度底本基金的组合中的计算机配置集中在 Saas（软件即服务）、人工智能、信息安全、智能硬件开发平台和金融科技方向，非计算机配置集中在音乐和影视制作领域。

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 2.40%，同期业绩比较基准收益率为 2.60%。

§ 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 | 82,165,036.40 | 31.63 |
| | 其中：股票 | 82,165,036.40 | 31.63 |
| 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 | 153,300,000.00 | 59.01 |
| | 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 | 24,267,009.12 | 9.34 |
| 7 | 其他各项资产 | 61,159.84 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 259,793,205.36 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 54,510,010.00 | 21.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 27,655,026.40 | 10.68 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 82,165,036.40 | 31.73 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.3 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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 002530 | 丰东股份 | 836,100 | 17,474,490.00 | 6.75 |
| 2 | 002655 | 共达电声 | 877,100 | 15,673,777.00 | 6.05 |
| 3 | 300297 | 蓝盾股份 | 395,776 | 6,589,670.40 | 2.54 |
| 4 | 300496 | 中科创达 | 31,200 | 6,020,976.00 | 2.32 |
| 5 | 002537 | 海立美达 | 209,500 | 5,105,515.00 | 1.97 |
| 6 | 300367 | 东方网力 | 155,600 | 4,750,468.00 | 1.83 |
| 7 | 300369 | 绿盟科技 | 113,000 | 4,522,260.00 | 1.75 |
| 8 | 002452 | 长高集团 | 372,600 | 4,508,460.00 | 1.74 |
| 9 | 300188 | 美亚柏科 | 142,700 | 4,241,044.00 | 1.64 |
| 10 | 300365 | 恒华科技 | 110,000 | 3,872,000.00 | 1.50 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

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 | 6,192.76 |

| | | |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 54,967.08 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 61,159.84 |

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

| | |
|-------------------------|----------------|
| 基金合同生效日基金份额总额 | 252,810,701.53 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 252,810,701.53 |

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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科技动力股票型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安科技动力股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安科技动力股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安科技动力股票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

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