国联安德盛增利债券证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年一月二十日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证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。

本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月13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。

本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,投资者在做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2009年10月1日起至12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	941,713,720.96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信标普全债指数。	
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	
下属两级基金的基金简称	国联安增利债券A	国联安增利债券B
下属两级基金的交易代码	253020	253021
报告期末下属两级基金的份额总额	386,463,107.60份	555,250,613.36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(2009年10月1日-2009年12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	4,853,335.06	5,816,339.05
2.本期利润	14,741,158.98	22,868,818.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0494	0.0563
4.期末基金资产净值	403,895,199.41	580,792,337.12
5.期末基金份额净值	1.045	1.046

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。

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3个月	5.04%	0.24%	0.36%	0.04%	4.68%	0.20%

2.国联安增利债券B:

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3个月	4.85%	0.25%	0.36%	0.04%	4.49%	0.21%

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

累计份额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2009年12月31日)

1.国联安增利债券A:

本基金业绩比较基准为中信标普全债指数。

*该基金基金合同于2009年3月11日生效。

本基金建仓期自基金合同生效之日2009年3月11日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

2.国联安增利债券B:

本基金业绩比较基准为中信标普全债指数。

*该基金基金合同于2009年3月11日生效。

本基金建仓期自基金合同生效之日2009年3月11日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§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		
冯俊	本基金的基金经理、兼任固定收益负责人	2009-3-11	-	9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。自2008年10月起加入国联安基金管理有限公司,自2009年3月起任本基金基金经理。
苏玉平	本基金的基金经理	2009-3-11	-	11年(自1999年起	苏玉平女士,CFA,上海财经大学经济学硕士。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理;交通银行总行内控处经理、市场和研发处经理;中国安联保险有限公司投资部经理。2007年8月加入国联安基金管理公司,任债券投资经理,自2009年3月起任本基金基金经理。

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

中国证监会于2008年3月20日颁布《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人组织各相关部门展开认真讨论,并最终制定了相应的工作计划。为了所管理的不同投资组合得到公平的对待,充分保护基金持有人、公司股东和公司的合法权益,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》,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行为监控和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所有指令;如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时采用交易系统中的公平交易模块;自主编程并开发交易监控程序,通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析;定期对投资流程进行独立稽核等。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制和监察稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的投资行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下共有8只基金,分别为国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛小盘精选证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、国联安德盛优势股票证券投资基金、国联安德盛红利股票证券投资基金、国联安德盛增利债券证券投资基金和国联安主题驱动股票型证券投资基金。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的基金,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 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

2009年第四季度来看,美国12月公布的PMI领先指标等数据显示经济复苏的势头依然强劲,但从住宅销量的反复中不难看出美国经济的复苏目前仍属不济政策的支持,金融危机的目发性恢复也要等到2010年下半年;欧元区经济的领先指数显示正增长有望在4季度转续;外需支撑下的日本经济也在持续复苏。金球物价方面,原油和铜铝等大宗商品价格并见到美元指数上涨的影响,其价格走势有望持续获得实体经济支撑;而经济复苏和大宗商品价格回升使欧美经济纷纷摆脱通缩,但日本由于高油价负基数效应和国内需求萎靡,通缩形势依然严峻。

中国经济和物价方面,第四季度10月、11月中国PMI指数、M1、M2等指标同比增长迅速,显示经济正持续扩张,经济活力增强。物价稳升势头十分强劲,未来无论是货款余额还是PPI、CPI均面临着持续上升的压力。下半年以来,固定资产投资和消费保持增长势头。进出口微降对国内经济的负面影响还是比较明显,但是逐步有所好转。

由于对美国经济增长速度和联储加息时间预期的推迟,以及中国放贷力度的降低,逐步弱化对中国经济过热的担忧,预期利润,第四季度的债券市场在经历了信用产品的急跌之后,中期信用品种已经具有了一定的投资配置价值。第四季度出于对银行流动性压力、通胀因素的担忧,利率走势波动较之为大。

在本季度,增利基金的操作对利率类品种操作比较谨慎,主要是推持短久期策略和高流动性组合,避免利率风险造成基金资产的损失。适当参与信用产品投资,精选低久期、资质好的信用品种;另外保持债券资产的高回购融资能力,积极参与新股申购。不轻易涉及权益性转债品种,避免权益性资产的过度波动对债券净值的影响。

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的净值增长率为5.04%,业绩比较基准收益率为0.36%;国联安增利债券B的净值增长率为4.85%,业绩比较基准收益率为0.36%。

§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	73,073,115.20	7.23
	其中:股票	73,073,115.20	7.23
2	固定收益投资	675,648,241.85	66.83
	其中:债券	675,648,241.85	66.83
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	240,101,064.09	23.75
6	其他资产	22,102,266.38	2.19
7	合计	1,010,924,687.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	3,675,685.44	0.37
B	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	43,981,602.29	4.47
C0	食品、饮料	7,741,718.16	0.79
C1	纺织、服装、皮毛	2,208,562.38	0.22
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	2,874,663.70	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,980,373.08	0.51
C5	电子	1,175,188.70	0.12
C6	金属、非金属	3,918,329.95	0.40
C7	机械、设备、仪表	16,223,340.99	1.65
C8	医药、生物制品	4,859,425.33	0.49
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	815,370.96	0.08
F	交通运输、仓储业	1,871,652.60	0.19
G	信息技术业	7,008,536.70	0.71
H	批发和零售贸易	4,478,307.75	0.45
I	金融、保险业	401,320.45	0.04
J	房地产业	1,158,954.97	0.12
K	社会服务业	7,339,212.24	0.75
L	传播与文化产业	2,342,471.80	0.24
M	综合类	0.00	0.00
	合计	73,073,115.20	7.42

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	300021	大禹节水	110,204	4,540,404.80	0.46
2	300022	吉峰农机	73,717	4,478,307.75	0.45
3	002311	海大集团	117,927	4,426,979.58	0.45
4	002328	新朋股份	133,495	3,544,292.25	0.36
5	300027	华谊兄弟	42,260	2,342,471.80	0.24
6	300009	安科生物	54,427	2,322,400.09	0.24
7	601888	中国国旅	104,252	2,183,036.88	0.22
8	002304	洋河股份	18,188	2,073,250.12	0.21
9	002321	华英农业	77,707	2,067,783.27	0.21
10	300031	宝通带业	36,316	2,049,311.88	0.21

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	186,770,054.60	18.97
2	央行票据	229,763,000.00	23.33
3	金融债券	29,387,000.00	2.98
	其中:政策性金融债	29,387,000.00	2.98
4	企业债券	218,021,582.83	22.14
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	11,706,604.42	1.19
7	其他	-	-
8	合计	675,648,241.85	68.62

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	010110	21国债(0)	1,262,740	129,165,674.60	13.12
2	0901049	09央票49	600,000	59,802,000.00	6.07
3	0901063	09央票63	500,000	49,835,000.00	5.06
4	126012	08上港债	452,620	44,130,450.00	4.48
5	0901053	09央票53	400,000	39,868,000.00	4.05

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本期投资的前十名证券中,无投资期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

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

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	125,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,390,178.86
5	应收申购款	16,587,087.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,102,266.38

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110078	澄星转债	5,872,125.70	0.60
2	125709	唐钢转债	5,533,738.72	0.56
3	125960	锡业转债	300,740.00	0.03

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300022	吉峰农机	4,478,307.75	0.45	召开临时股东大会

§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
报告期期初基金份额总额	267,990,240.59	513,142,435.54
报告期期间基金总申购份额	160,233,593.58	567,441,541.71
报告期期间基金总赎回份额	41,760,726.57	525,333,363.89
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	386,463,107.60	555,250,613.36

§7 备查文件目录

7.1 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招募说明书》

4、《国联安德盛增利债券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

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦46楼

7.3 查阅方式

网址:http://www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

国联安德盛稳健证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年一月二十日

§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2010年1月13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2009年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安稳健混合
基金主代码	255010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月8日
报告期末基金份额总额	181,282,743.21份
投资目标	本基金为平衡型基金,基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验,深入研究中国经济发展的价值驱动因素,采用积极主动的投资策略,运用全程风险管理技术,追求长期稳定的投资收益,为基金持有人提供安全可靠的理财服务。
投资策略	本基金严格遵守科学的投资管理流程,首先采取"自上而下"的分析方法,制定基金资产类别配置和行业配置策略,然后采取"自下而上"的基本面分析,挖掘出管理团队优秀、财务状况良好、增长潜力大、竞争地位独特的上市公司和预期收益率较高的债券。利用全球投资经验和对国内市场的深入了解,在对市场趋势准确判断的前提下,进行积极的战略性和战术性资产配置和调整,构建在既定投资风险下的最优投资组合。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准=国泰君安指数x65%+上证国债指数x35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其风险收益特征从长期平均及预期来看,介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间,也介于单纯的成长型组合与单纯的价值型组合之间。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。
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

§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(2009年10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	33,243,480.74
2.本期利润	26,854,465.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1473
4.期末基金资产净值	328,445,766.22
5.期末基金份额净值	1.812

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。

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3个月	8.73%	1.14%	14.32%	1.06%	-5.59%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

国联安德盛稳健证券投资基金

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

(2003年8月8日至2009年12月31日)

本基金整体业绩比较基准=国泰君安指数x65%+上证国债指数x35%

*该基金基金合同于2003年8月8日生效。

本基金建仓期自基金合同生效之日2003年8月8日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§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		
傅明笑	本基金基金经理	2008-8-16	-	6年(自2004年开始)	傅明笑先生,硕士研究生,于2004年7月加入海通证券股份有限公司任研究员,2005年12月加入国联安基金管理有限公司,历任研究员、高级研究员兼基金经理助理,2008年8月起任本基金基金经理。

1.基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日。

2.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安德盛稳健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

中国证监会于2008年3月20日颁布《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本基金管理人组织各相关部门展开认真讨论,并最终制定了相应的工作计划。为了所管理的不同投资组合得到公平的对待,充分保护基金持有人、公司股东和公司的合法权益,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》,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行为监控和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所有指令;如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时采用交易系统中的公平交易模块;自主编程并开发交易监控程序,通过技术手段对不同投资组合的交易价差定期进行分析;定期对投资流程进行独立稽核等。

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好。在内部风险控制和监察稽核方面未发现本基金有重大违反公平交易制度的投资行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下共有8只基金,分别为国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛小盘精选证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、国联安德盛优势股票证券投资基金、国联安德盛红利股票证券投资基金、国联安德盛增利债券证券投资基金和国联安主题驱动股票型证券投资基金。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的基金,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 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

本基金管理人旗下共有8只基金,分别为国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛小盘精选证券投资基金、国联安德盛安心成长混合型证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、国联安德盛优势股票证券投资基金、国联安德盛红利股票证券投资基金、国联安德盛增利债券证券投资基金和国联安主题驱动股票型证券投资基金。由于本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的基金,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为8.73%,业绩比较基准收益率为14.32%。

§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	224,028,460.87	67.20
	其中:股票	224,028,460.87	67.20
2	固定收益投资	85,086,778.80	25.52
	其中:债券	85,086,778.80	25.52
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	314,028.45	0.09
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	22,483,592.09	6.74
6	其他资产	1,464,752.56	0.44
7	合计	333,377,612.77	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	10,252,360.00	3.12
B	采掘业	38,907,013.00	11.85
C	制造业	43,053,140.72	13.11
C0	食品、饮料	10,252,360.00	3.12
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	5,307,500.00	1.62
C7	机械、设备、仪表	17,738,000.00	5.40
C8	医药、生物制品	9,755,280.72	2.97
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	1,721,370.00	0.52
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	7,348,016.16	2.24
H	批发和零售贸易	19,570,300.00	5.96
I	金融、保险业	70,004,052.36	21.31
J	房地产业	32,950,868.63	10.03
K	社会服务业	10,473,700.00	3.19
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	224,028,460.87	68.21

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	601628	中国人寿	539,904	17,109,557.76	5.21
2	600016	民生银行	1,600,000	12,656,000.00	3.85
3	600048	保利地产	520,000	11,648,000.00	3.55
4	000069	华侨城A	610,000	10,473,700.00	3.19
5	601318	中国平安	189,940	10,463,794.60	3.19
6	000933	神火股份	280,000	10,326,400.00	3.14
7	000024	招商地产	369,991	9,852,860.33	3.00
8	600030	中信证券	310,000	9,848,700.00	3.00
9	601899	紫金矿业	1,000,000	9,640,000.00	2.94
10	002024	苏宁电器	450,000	9,351,000.00	2.85

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	59,024,617.40	17.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,598,000.00	5.97
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	6,464,161.40	1.97
7	其他	-	-
8	合计	85,086,778.80	25.91

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	010112	21国债(2)	296,470	30,402,998.50	9.26
2	010110	21国债(0)	245,210	25,082,530.90	7.64
3	090403	09农发03	200,000	19,598,000.00	5.97
4	010004	20国债(4)	35,110	3,539,088.00	1.08
5	110003	新钢转债	22,000	3,026,760.00	0.92

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580027	长虹CWB1	102,758	314,028.45	0.10

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金本期投资的前十名证券中,无投资期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	728,241.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	730,553.31
5	应收申购款	3,456.77
6	其他应收款	2,501.29
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,464,752.56

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	3,026,760.00	0.92
2	110078	澄星转债	2,030,560.00	0.62
3	125709	唐钢转债	1,406,841.40	0.43

5.8.5 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

报告期期初基金份额总额	183,901,661.50
报告期期间基金总申购份额	2,036,502.55
报告期期间基金总赎回份额	4,655,420.84
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	181,282,743.21

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安德盛稳健证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安德盛稳健证券投资基金基金合同》

3、《国联安德盛稳健证券投资基金招募说明书》

4、《国联安德盛稳健证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、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

7.2 存放地点

上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦46楼

7.3 查阅方式

网址:http://www.gtja-allianz.com

国联安基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十日

国联安基金管理有限公司
关于国联安德盛稳健证券投资基金分红的预告

一、收益分配

国联安基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")所管理的国联安德盛稳健证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同于2003年8月8日生效,根据《证券投资基金运作管理办法》的有关规定及《国联安德盛稳健证券投资基金基金合同》的约定,本基金管理人决定对本基金实施分红,现将具体分红方案预公告如下:

(一)收益分配方案:经本基金管理人计算并由基金托管人中国工商银行股份有限公司复核,以2010年1月11日已实现的可分配收益为基准,本基金拟向基金持有人按每10份基金份额派发红利1元,现执行方案以分红公告为准。

(二)收益分配时间

1.权益登记日:除息日:2010年1月25日

2.红利分配日:2010年1月26日

3.选择红利再投资的投资者,其现金红利将按2010年1月26日的基金份额资产净值转换为基金份额。

4.具体分红方案公告日:2010年1月23日

(三)收益分配对象

权益登记日在注册登记机构——国联安基金管理有限公司登记在册的本基金全体持有人。

(四)收益发放方法

1.选择现金红利方式的投资者的红利款将于2010年1月26日自基金托管账户划出。

2、选择红利再投资方式的投资者所转换的基金份额将于2010年1月27日直接计入其基金账户,2010年1月28日起可以查询、赎回。

(五)有关税收和费用的说明

1.根据财政部、国家税务总局的财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金向投资者分配的基金收益,暂免征收所得税。

2.本基金本次分红免收分红手续费和红利再投资费用。

(六)提示

1.权益登记日申请申购的基金份额不享有本次分红权益,权益登记日申请赎回的基金份额享有本次分红权益。

2.基金持有人可以在基金开放日的交易时间内到销售网点选择或更改分红方式,最终分红方式以权益登记日之前(不含2010年1月25日)最后一次选择的分红方式为准。对于未在权益登记日之前选择具体分红方式的投资者,本基金默认的分红方式为现金分红方式。

3.请投资者到销售网点查询分红方式,若希望更改分红方式的,请务必在规定的时间前到销售网点办理变更手续。

4.因分红导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,也不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

5.因分红导致基金份额净值调整至1元附近,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面