

申购(17%)	50万元以下	1.50%
国联安优选行业股票	50万(含)至100万	1.20%
	100万(含)至500万	0.80%
	500万(含)至1000万	0.30%
国联安增利债券A	100万以下	0.80%
	100万(含)至300万	0.50%
国联安安心增利债券	300万(含)至500万	0.30%
	500万(含)及以上	每笔交易1000元
国联安增利债券B	全部	0.00%
国联安货币	全部	0.00%

上述申购费率可根据本公司公告而进行调整,届时以最新公布的费率为准。  
 前份份额之间转换的申购补差费率按转出金额对转入基金的申购费率与转出基金的申购费率作为依据来计算。后份份额之间转换的申购补差费率为零,因此申购补差费为零。  
 投资者通过网上直销平台申购前端的收费模式下本基金与本公司旗下其他开通基金转换业务的开放式基金同基金转换业务,享受转换费中应前申购补差费率的优惠,其他费率标准不变。  
 本基金管理人有权根据业务情况调整上述交易费用,并依照相关法律法规进行公告。  
 4) 转出份额的办理基金转换业务适用的转换费率将在开通日另行公告。  
 2) 申购份额的计算公式:  
 转出金额-转出基金份额×转出基金当日基金份额净值  
 转出手续费+转出基金的赎回费=申购补差费  
 其中:  
 转出手续费=申购金额×转出基金赎回费率  
 申购补差费率=转出金额×赎回费率×(1+申购补差费率) / (1+申购补差费率)  
 (1) 如果转入基金的申购费率 > 转出基金的申购费率  
 转换费用=转出基金的赎回费+申购补差费  
 (2) 如果转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率  
 转换费用=转出基金的赎回费  
 (3) 转入金额 = 转出金额 / 转入基金当日基金份额净值  
 (4) 转入份额 = 转入金额 / 转入基金当日基金份额净值  
 其中,转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出份额作为确定依据。  
 注:转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。  
 3) 基金转换业务示例:  
 例: 某投资者于某日通过本公司网上交易平台将其持有的国联安精选股票基金500,000份转换为国联安安心混合基金。假设转换申请受理当日国联安精选股票基金基金单位资产净值为1.250元,国联安安心混合基金的基金单位资产净值为1.050元,假设该投资者持有国联安精选股票基金不满1年,则国联安精选股票基金赎回费率为转出份额×国联安精选股票基金当日基金单位资产净值×国联安精选股票基金赎回费率  
 =500,000×1.250×0.5%=312.50元  
 申购补差费=转出金额-转出金额×转出基金赎回费率×(1+申购补差费率) / (1+申购补差费率)  
 =500,000×1.250×0.5%×1.05% / (1+0.5%) =3107.80元  
 转入金额=转入份额×国联安安心混合基金当日基金单位资产净值-赎回费-申购补差费  
 =500,000×1.050-312.50-3107.80=621,579.70元  
 转入份额=转入金额/国联安安心混合基金当日单位基金资产净值  
 =621,579.70/1.050=591,980.67份

4) 业务规则:  
 1) 基金转换以份额为单位进行申请。投资者办理基金转换业务时,转出方的基金必须处于可赎回状态,转入方的基金必须处于可申购状态。  
 2) 基金转换采取未知价法,即以申请受理当日各转出、转入基金的基金单位资产净值为基础进行计算。  
 3) 正确情况下,基金注册与过户登记人将在T+1日对投资者的基金转换业务申请进行有效性确认,在T+2日后(包括该日)投资者可通过本公司直销业务平台查询基金转换的交易情况。  
 4) 目前,每次对上述单一基金转换业务的申请不得超过1000份基金份额,如因基金基金转出业务导致该基金基金单位资产净值下降10%时,基金管理人将该次基金转换业务保留的基金份额余额一次性集中赎回,单笔赎回申请不受基金最低赎回限制。  
 5) 单个开放式基金单笔赎回申请 赎回由申请份额与转出申请份额总数,扣除申购中基金份额与转入申请份额数后的余额 超过以上一开放日基金单位资产净值的10%时,即认为发生了巨额赎回。发生巨额赎回时,基金转出与基金赎回具有相同的优先级,基金管理人可根据基金资产组合情况,全额赎回或部分转出,并且对于基金赎回和基金转换,将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下,未确认的赎回申请将予以顺延。  
 6) 所有基金为当前赎回的基金份额将转换为其他前端收费模式的基金份额,后端收费模式下的基金份额转换为前端收费模式的基金份额。  
 5) 基金转换限制情形及处理:  
 出现下列情况之一时,基金管理人可以暂停基金转换业务:  
 1) 不可抗力导致基金无法正常运转。  
 2) 发生交易所所在交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。  
 3) 因市场剧烈波动或其他原因出现连续巨额赎回,基金管理人认为有必要暂停接受该基金单位转出申请。  
 4) 法律、法规、规章规定的其他情形或在《基金合同》、招募说明书已载明并获中国证监会批准的特殊情形。  
 发生上述情形之一的,基金管理人应在立即中国证监会备案并定期限内至少在一种中国证监会指定媒体上刊登暂停公告。重新开放基金转换时,基金管理人应最迟提前2个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登重新开放基金转换的公告。  
 6) 重要提示:  
 1) 基金发行期间内不定期受理基金交易申请,该基金成立并开放申购赎回业务后受理基金转换业务。新基金的转换限制以本公司公告为准。  
 2) 未经募销双方同意国联安精选混合、国联安小混合、国联安大混合、国联安精选股票、国联安优选股票、国联安红股票、国联安增利债券A、国联安增利债券B、国联安主题驱动股票、国联安上商品ETF股票、国联安安心混合基金等基金转换业务由基金管理人另行公告。  
 3) 本公司有权根据市场情况调整上述转换的程序及有关限制,但最迟应在调整生效前2个工作日内在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。  
 4) 本基金转换业务的解释权归本公司。  
 4) 本基金投资的目标:  
 在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动投资管理,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。

九、基金的投资范围  
 本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,具体如下:  
 1. 现金;  
 2. 通知存款;  
 3. 短期融资券;  
 4. 剩余期限在397天以内(含397天)的债券;  
 5. 剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;  
 6. 1年内(含1年)的银行定期存款、大额存单;  
 7. 期限在1年以内(含1年)的债券回购;  
 8. 期限在1年以内(含1年)的央行票据(以下简称“央行票据”);  
 9. 中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。  
 如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

十、基金的投资策略及程序  
 (一) 投资原则  
 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,在此基础上,通过组合久期策略和类别资产配置比例,把预期收益曲线形状和无风险利率变化进行品种选择,具体包括以下策略:  
 1. 利率预期策略  
 利率变化是影响债券价格最重要的因素,所以利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化及短期资金供给等因素的分析,形成对未来短期利率走势的判断,并在此基础上调整组合的期限和品种配置。如果预期利率下降,将调组合的久期;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的久期。  
 2. 收益平衡策略  
 短期资本市场与债券市场密切相关,连接两个市场的分析工具是收益平衡曲线。收益平衡曲线策略通过考察市场收益平衡曲线的动态变化进行资产配置,寻求在一段时期内获取收益平衡曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在组合平均剩余期限整体调整的基础上,本基金将比较不同的投资策略,例如分久期策略、久期策略和梯级策略等在不同市场环境下的表现,构建优化投资组合获取市场收益。  
 3. 类属配置策略  
 在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具(国债、金融债、央行票据、回购等)的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例,再通过评估各类资产的风险和收益性利率,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。  
 4. 现金流管理策略  
 根据对市场资金面分析以及对中短期变化的动态预测,通过合理的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整组合有效配置现金,在保持本基金无流动性风险的基础上争取较高收益。  
 5. 套利策略  
 套利策略包括正回购与银行间存款之间的套利,正回购与逆回购之间的套利,跨市场套利策略等。  
 正回购与逆回购之间的套利,指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后,再以金融同业存款利率存出,从而获得收益。  
 正回购与逆回购之间的套利包括跨日正回购与逆回购之间的套利和同日正回购与逆回购之间的套利。同日正回购与逆回购之间的套利,指的是在同一天市场利率低于金融同业存款利率的成本融入资金,而在T+1天之后定息的交割日高于金融同业存款利率的价格融出资金,从而获取收益。  
 同日正回购与逆回购之间的套利,指的是第一天以低于金融同业存款利率的价格融入资金,同时在当天以高于金融同业存款利率的价格在同一种产品上融出资金,从而获取收益。  
 跨市场套利是指短期金融工具在不同市场的不同表现进行套利,比如当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时,可通过增加交易所市场回购的配置比例,或在银行间市场回购利率高于交易所市场回购利率时,可通过增加交易所市场回购的配置比例,或在银行间市场回购利率高于交易所市场回购利率时,可在该市场进行融资,以在低利率市场进行融资,通过增加交易所市场回购的配置比例,或进行较短期融资,较长长期融资而实现跨期限套利。  
 6. 个券选择策略  
 根据上述资产配置要求,积极发掘价格被低估且符合流动性要求的适合投资的品种。通过分析各个具体金融产品的剩余期限与收益率的匹配状况、信用评级状况、流动性指标等因素进行证券选择,选择风险收益比合理的品种作为投资对象。具体而言,个券选择遵循以下一般原则:  
 ① 符合偿还资产配置策略;  
 ② 寻求短期信用评级被低估的个券;  
 ③ 寻求具有套利空间的个券;  
 ④ 符合风险管理指标,包括VAR和流动性指标的要求;  
 ⑤ 优先选择央行公开市场操作的个券。  
 C) 投资决策流程  
 1. 投资决策  
 有关法律、法规、基金合同等相关规定。  
 2. 投资管理程序  
 本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;决定重大投资组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。  
 3. 投资程序  
 ① 投资决策委员会确定整体投资战略;  
 ② 研究员根据自身或者其他研究机构的研究成果,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供资产配置、投资建议支持。  
 3. 基金经理根据投资决策委员会的投资战略,在研究员“研究报告”的指导下,结合对宏观经济和市场状况的判断,对所选基金的具体投资计划,包括:资产配置、类属配置、品种配置和个股选择,并定期和不定期向投资决策委员会提交交易策略报告,并持有相关信息反馈基金经理。  
 ④ 交易部执行有关交易规则执行,并持有相关信息反馈基金经理。  
 ⑤ 风险管理部,数量策略定期进行基金风险评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。  
 6. 风险管理部对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,重点关注基金投资组合的风险状况,并控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。  
 ⑦ 本基金管理人确保基金持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资策略,并予以公告。  
 十一、基金业绩比较基准  
 本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。  
 七天通知存款具有存期灵活、存取方便的特点,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金作为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征,这些特征与七天通知存款的特征较为接近,且同期七天通知存款利率具有权威、低风险的特点,鉴于此,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。  
 如果今后证券市场中有其他投资表现更强或更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际需要对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。  
 十二、基金的风险收益特征  
 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品种。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型股票及股票型基金。  
 十三、基金的投资组合报告  
 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。  
 本基金的投资人——国联安发展银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年7月14日复核了本报告中财务指标、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、误导性陈述或重大遗漏。本报告投资组合财务数据摘自2011年4月1日至2011年6月30日,本报告财务数据未经审计师审计。  
 1. 报告期末基金资产组合

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	固定收益投资	179,801,863.13	93.86
	其中:债券	179,801,863.13	93.86
	基金支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	10,640,886.69	5.55
4	其他各项资产	1,116,847.92	0.58
5	合计	191,559,757.74	100.00

2. 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
E	建筑业	177,645,000.00	2.23
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售业	426,979,725.76	5.35
I	金融、保险业	156,382,944.10	6.07
J	房地产业	243,249,569.57	3.45
K	社会服务业	19,433,073.66	0.24
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	277,165,101.27	3.47
N	合计	4,820,941,970.62	64.42

3. 期末基金投资前十名股票明细

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	002304	洋河股份	2,200,708	277,641,321.28	3.48
2	600418	江淮汽车	21,729,539	241,415,178.29	3.03
3	600036	招商银行	17,134,109	223,086,099.18	2.80
4	600970	中材国际	6,500,000	177,645,000.00	2.23
5	600585	海螺水泥	6,000,000	166,560,000.00	2.09
6	002277	友阿股份	7,395,434	166,491,912.38	2.09
7	600415	小商品城	13,239,878	162,718,100.62	2.04
8	000417	合创医药	8,858,309	161,223,223.80	2.02
9	000568	泸州老窖	3,361,654	151,677,828.48	1.90
10	600048	保利地产	13,057,010	143,496,539.80	1.80

4. 期末按持仓种类分明的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	1,374,705,000.00	17.23
3	金融债	298,010,000.00	3.73
	其中:政策性金融债	298,010,000.00	3.73
4	企业债	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	385,666,945.14	4.83
7	其他	99,370,000.00	1.25
8	合计	2,068,381,945.14	25.80

5. 期末债券投资组合前五名债券

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	1001060	10央行票据60	7,000,000	682,710,000.00	8.56
2	1101023	11央票23	4,000,000	397,000,000.00	4.98
3	110001	10央行票据	3,500,000	369,530,000.00	4.63
4	080222	08国开22	2,000,000	198,640,000.00	2.49
5	080221	08国开21	1,000,000	99,370,000.00	1.25

6. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名资产支持证券投资明细  
 本基金未持有资产支持证券。  
 7. 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名权益投资明细  
 本基金未持有权益类投资。  
 8. 投资组合报告附注  
 (1) 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内未受到过公开谴责、处罚。  
 5.8.3 其他资产构成

四、基金的投资目标  
 本基金的投资目标是:在控制风险和保证流动性的前提下,通过主动投资管理,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。  
 五、基金的风险收益特征  
 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品种。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型股票及股票型基金。  
 六、基金的投资范围  
 本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,具体如下:  
 1. 现金;  
 2. 通知存款;  
 3. 短期融资券;  
 4. 剩余期限在397天以内(含397天)的债券;  
 5. 剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;  
 6. 1年内(含1年)的银行定期存款、大额存单;  
 7. 期限在1年以内(含1年)的债券回购;  
 8. 期限在1年以内(含1年)的央行票据(以下简称“央行票据”);  
 9. 中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。  
 如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

七、基金的投资策略及程序  
 (一) 投资原则  
 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,在此基础上,通过组合久期策略和类别资产配置比例,把预期收益曲线形状和无风险利率变化进行品种选择,具体包括以下策略:  
 1. 利率预期策略  
 利率变化是影响债券价格最重要的因素,所以利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化及短期资金供给等因素的分析,形成对未来短期利率走势的判断,并在此基础上调整组合的期限和品种配置。如果预期利率下降,将调组合的久期;反之,如果预期利率将上升,则缩短组合的久期。  
 2. 收益平衡策略  
 短期资本市场与债券市场密切相关,连接两个市场的分析工具是收益平衡曲线。收益平衡曲线策略通过考察市场收益平衡曲线的动态变化进行资产配置,寻求在一段时期内获取收益平衡曲线变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在组合平均剩余期限整体调整的基础上,本基金将比较不同的投资策略,例如分久期策略、久期策略和梯级策略等在不同市场环境下的表现,构建优化投资组合获取市场收益。  
 3. 类属配置策略  
 在保持组合资产相对稳定的条件下,根据各类短期金融工具(国债、金融债、央行票据、回购等)的市场规模、收益性和流动性,决定各类资产的配置比例,再通过评估各类资产的风险和收益性利率,确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。  
 4. 现金流管理策略  
 根据对市场资金面分析以及对中短期变化的动态预测,通过合理的滚动操作和债券品种的期限结构搭配,动态调整组合有效配置现金,在保持本基金无流动性风险的基础上争取较高收益。  
 5. 套利策略  
 套利策略包括正回购与银行间存款之间的套利,正回购与逆回购之间的套利,跨市场套利策略等。  
 正回购与逆回购之间的套利,指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后,再以金融同业存款利率存出,从而获得收益。  
 正回购与逆回购之间的套利包括跨日正回购与逆回购之间的套利和同日正回购与逆回购之间的套利。同日正回购与逆回购之间的套利,指的是在同一天市场利率低于金融同业存款利率的成本融入资金,而在T+1天之后定息的交割日高于金融同业存款利率的价格融出资金,从而获取收益。  
 同日正回购与逆回购之间的套利,指的是第一天以低于金融同业存款利率的价格融入资金,同时在当天以高于金融同业存款利率的价格在同一种产品上融出资金,从而获取收益。  
 跨市场套利是指短期金融工具在不同市场的不同表现进行套利,比如当交易所市场回购利率高于银行间市场回购利率时,可通过增加交易所市场回购的配置比例,或在银行间市场回购利率高于交易所市场回购利率时,可通过增加交易所市场回购的配置比例,或在银行间市场回购利率高于交易所市场回购利率时,可在该市场进行融资,以在低利率市场进行融资,通过增加交易所市场回购的配置比例,或进行较短期融资,较长长期融资而实现跨期限套利。  
 6. 个券选择策略  
 根据上述资产配置要求,积极发掘价格被低估且符合流动性要求的适合投资的品种。通过分析各个具体金融产品的剩余期限与收益率的匹配状况、信用评级状况、流动性指标等因素进行证券选择,选择风险收益比合理的品种作为投资对象。具体而言,个券选择遵循以下一般原则:  
 ① 符合偿还资产配置策略;  
 ② 寻求短期信用评级被低估的个券;  
 ③ 寻求具有套利空间的个券;  
 ④ 符合风险管理指标,包括VAR和流动性指标的要求;  
 ⑤ 优先选择央行公开市场操作的个券。  
 C) 投资决策流程  
 1. 投资决策  
 有关法律、法规、基金合同等相关规定。  
 2. 投资管理程序  
 本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责制定基金投资方面的整体投资计划与投资原则;决定重大投资组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理根据投资决策委员会的决策,负责投资组合的构建、调整和日常管理等工作。  
 3. 投资程序  
 ① 投资决策委员会确定整体投资战略;  
 ② 研究员根据自身或者其他研究机构的研究成果,对拟投资对象进行持续跟踪调研,并提供资产配置、投资建议支持。  
 3. 基金经理根据投资决策委员会的投资战略,在研究员“研究报告”的指导下,结合对宏观经济和市场状况的判断,对所选基金的具体投资计划,包括:资产配置、类属配置、品种配置和个股选择,并定期和不定期向投资决策委员会提交交易策略报告,并持有相关信息反馈基金经理。  
 ④ 交易部执行有关交易规则执行,并持有相关信息反馈基金经理。  
 ⑤ 风险管理部,数量策略定期进行基金风险评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。  
 6. 风险管理部对识别、防范、控制基金运作各个环节的风险全面负责,重点关注基金投资组合的风险状况,并控制基金投资组合的市场风险和流动性风险。  
 ⑦ 本基金管理人确保基金持有人利益的前提下,有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资策略,并予以公告。  
 十一、基金业绩比较基准  
 本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。  
 七天通知存款具有存期灵活、存取方便的特点,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金作为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征,这些特征与七天通知存款的特征较为接近,且同期七天通知存款利率具有权威、低风险的特点,鉴于此,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。  
 如果今后证券市场中有其他投资表现更强或更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际需要对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准须经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前3个工作日内在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。  
 十二、基金的风险收益特征  
 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品种。在一般情况下,其风险与预期收益均低于债券型基金,也低于混合型股票及股票型基金。  
 十三、基金的投资组合报告  
 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。  
 本基金的投资人——国联安发展银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2011年7月10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、误导性陈述或重大遗漏。本报告投资组合财务数据截至2011年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。  
 1. 期末基金资产组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,820,941,970.62	60.26
	其中:股票	4,820,941,970.62	60.26
2	固定收益投资	2,058,381,945.14	25.73
	其中:债券	2,058,381,945.14	25.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	396,001,056.00	4.95
	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	683,448,239.55	8.54
6	其他各项资产	41,748,577.92	0.52
7	合计	8,000,521,769.28	100.00

2. 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	-	-
B	采矿业	259,361,311.36	3.25
C	制造业	2,900,725,249.90	36.35
D	货物、贸易	603,104,132.30	7.56
CD	纺织、服装、皮毛	268,500,666.50	3.37
CE	造纸、印刷	-	-
CF	石油、化学、塑胶、塑料	228,763,428.40	2.87
CG	电子	46,614,978.86	0.58
CH	金属、非金属	835,913,545.14	10.48
CI	机械、设备、仪表	735,033,871.61	9.22
CJ	医药、生物制品	182,290,460.68	2.28
CO	其他制造业	-	-
CS	其他采矿业	-	-
CT	其他制造业	-	-
CC	其他采矿业	-	-
CC	其他采矿业	-	-
CC	其他采矿业	-	-

基金托管人中国工商银行根据本基金基金合同约定,于2011年7月10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、误导性陈述或重大遗漏。  
 本投资组合报告所载数据截至2011年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。  
 1. 期末基金资产组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,820,941,970.62	60.26
	其中:股票	4,820,941,970.62	60.26
2	固定收益投资	2,058,381,945.14	25.73
	其中:债券	2,058,381,945.14	25.73
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	396,001,056.00	4.95
	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	683,448,239.55	8.54
6	其他各项资产	41,748,577.92	0.52
7	合计	8,000,521,769.28	100.00

2. 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	-	-
B	采矿业	259,361,311.36	3.25
C	制造业	2,900,725,249.90	36.35
D	货物、贸易	603,104,132.30	7.56
CD	纺织、服装、皮毛	268,500,666.50	3.37
CE	造纸、印刷	-	-
CF	石油、化学、塑胶、塑料	228,763,428.40	2.87
CG	电子	46,614,978.86	0.58
CH	金属、非金属	835,913,545.14	10.48
CI	机械、设备、仪表	735,033,871.61	9.22
CJ	医药、生物制品	182,290,460.68	2.28
CO	其他制造业	-	-
CS	其他采矿业	-	-
CT	其他制造业	-	-
CC	其他采矿业	-	-
CC	其他采矿业	-	-
CC	其他采矿业	-	-

基金托管人中国工商银行根据本基金基金合同约定,于2011年7月10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、误导性陈述或重大遗漏。  
 本投资组合报告所载数据截至2011年6月