# 国联安德盛稳健证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30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:二〇一一年十月二十六日**

### §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2011年10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2011年7月1日起至9月30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 |
| 交易代码 | 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 | 263,496,818.07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 | 沪深300指数×65%+上证国债指数×35% |
| 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(2011年7月1日-2011年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -8,140,626.70 |
| 2.本期利润 | -21,086,940.95 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0781 |
| 4.期末基金资产净值 | 235,672,010.32 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.894 |

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。

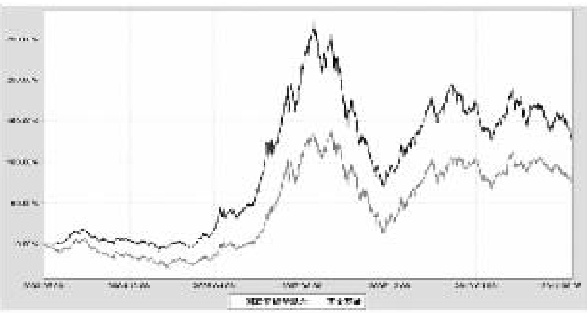
3.2 基金净值表现

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 | -8.87% | 0.84% | -9.74% | 0.86% | 0.87% | -0.02% |

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
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年8月8日至2011年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为沪深300指数×65%+上证国债指数×35%;

2、本基金基金合同于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、兼任国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理 | 2008-8-16 | - | 7年(自2004年起) | 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、基金经理助理,2008年8月起担任本基金基金经理,2010年5月起兼任国联安德盛红利股票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 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》(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

截止至本报告期末,本基金管理人旗下共有14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、国联安主题驱动股票型证券投资基金、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金、国联安信心增益债券型证券投资基金、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安货币市场证券投资基金和国联安优选行业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

2011年第三季度是A股损失较大的一个季度,自2011年5月份宏观调控显出效果以来,初始的宏观经济活力下滑演变成各类微观企业大范围的盈利下降,不少行业在政策紧缩、资金匮乏的压力下,利润显示出大幅跳水的迹象。在A股市场,在企业利润下滑的预期和资金面紧张的双重压力下,股票呈现较大幅度的下跌趋势。本基金在第三季度适时降低了仓位,然而在市场普遍下跌的背景下,本基金表现不甚理想。

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-8.87%,同期业绩比较基准收益率为-9.74%。

### §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 | 141,538,001.83 | 59.68 |
| | 其中:股票 | 141,538,001.83 | 59.68 |
| 2 | 固定收益投资 | 71,111,654.45 | 29.99 |
| | 其中:债券 | 71,111,654.45 | 29.99 |
| | 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 | 22,707,843.65 | 9.58 |
| 6 | 其他各项资产 | 1,799,720.95 | 0.76 |
| 7 | 合计 | 237,157,220.88 | 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 | 4,048,933.50 | 1.72 |
| B | 采掘业 | 4,059,630.00 | 1.72 |
| C | 制造业 | 97,161,664.91 | 41.23 |
| C0 | 食品、饮料 | 18,041,309.80 | 7.66 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,718,600.00 | 1.15 |
| C5 | 电子 | 34,972,246.66 | 14.84 |
| C6 | 金属、非金属 | - | - |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 23,386,270.50 | 9.92 |
| C8 | 医药、生物制品 | 18,043,237.95 | 7.66 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 11,654,772.81 | 4.95 |
| H | 批发和零售贸易 | 10,487,400.00 | 4.45 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 4,145,157.00 | 1.76 |
| K | 社会服务业 | 9,980,443.61 | 4.23 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 141,538,001.83 | 60.06 |

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 | 000858 | 五粮液 | 360,500 | 13,086,150.00 | 5.55 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 234,802 | 9,331,031.48 | 3.96 |
| 3 | 000423 | 东阿阿胶 | 188,455 | 7,818,997.95 | 3.32 |
| 4 | 600216 | 浙江医药 | 296,000 | 7,752,240.00 | 3.29 |
| 5 | 002535 | 林州重机 | 431,950 | 6,781,615.00 | 2.88 |
| 6 | 600271 | 航天信息 | 239,901 | 6,479,726.01 | 2.75 |
| 7 | 300171 | 东富龙 | 145,000 | 6,235,000.00 | 2.65 |
| 8 | 600694 | 大商股份 | 139,000 | 5,587,800.00 | 2.37 |
| 9 | 300124 | 汇川技术 | 78,370 | 5,497,655.50 | 2.33 |
| 10 | 002273 | 水晶光电 | 159,976 | 5,308,003.68 | 2.25 |

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 | 54,716,663.60 | 23.22 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 16,394,990.85 | 6.96 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 71,111,654.45 | 30.17 |

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⑿ | 312,020 | 31,258,163.60 | 13.26 |
| 2 | 010203 | 02国债(3) | 234,000 | 23,458,500.00 | 9.95 |
| 3 | 113001 | 中行转债 | 157,200 | 14,303,628.00 | 6.07 |
| 4 | 110078 | 澄星转债 | 16,000 | 1,890,400.00 | 0.80 |
| 5 | 125887 | 中鼎转债 | 1,938 | 200,962.85 | 0.09 |

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 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除五粮液外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

五粮液(000858)于2011年5月28日发布公告称,接到中国证券监督管理委员会关于信息披露违法的《行政处罚决定书》。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 598,780.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,199,260.61 |
| 5 | 应收申购款 | 1,679.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,799,720.95 |

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 | 113001 | 中行转债 | 14,303,628.00 | 6.07 |
| 2 | 110078 | 澄星转债 | 1,890,400.00 | 0.80 |
| 3 | 125887 | 中鼎转债 | 200,962.85 | 0.09 |

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 | 334,062,323.48 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 834,387.53 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 71,399,892.94 |
| 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 | 263,496,818.07 |

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 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

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

7.3 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**
**二〇一一年十月二十六日**

---

# 国联安德盛小盘精选证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30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:二〇一一年十月二十六日**

### §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2011年10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2011年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国联安小盘精选混合 |
| 基金主代码 | 257010 |
| 交易代码 | 257010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年4月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,441,447,551.66份 |
| 投资目标 | 本基金是一只积极成长型股票基金,专注投资于中国A股市场上具有成长潜力的小盘股。基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验,在严格的风险控制机制下,采用积极主动的投资策略,通过多角度、多层次的基本面研究,充分发掘小盘股所具有的潜在成长性所带来的投资机会,并通过波段操作的择时策略追求较高的资本利得收益,从而实现投资者资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次是自下而上的证券选择。总体上说,对于本基金的投资重点——小盘股而言,将采取自下而上的方式,综合使用数量化的金融工程模型、科学严谨的财务分析和深入的上市公司调研与独特的草根研究等多种手段精选个股,并在此基础上构建股票投资组合。第二个层次是资产类别配置层面的风险管理,即对基金资产在股票、债券和现金三大资产类别间的配置进行实时监控,并根据当时的宏观经济形势和证券市场行情调整资产配置比例,达到控制基金风险的目的。总之,本基金在投资管理的每一个层次都将定性研究和量化分析有机地结合起来,从而保证投资决策的科学性与风险收益结构的最优性。 |
| 业绩比较基准 | (天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只积极成长型的股票基金,由于其股票投资组合以小盘股为主,本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。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(2011年7月1日-2011年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -93,190,431.76 |
| 2.本期利润 | -306,185,502.41 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1246 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,758,658,984.57 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.720 |

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。

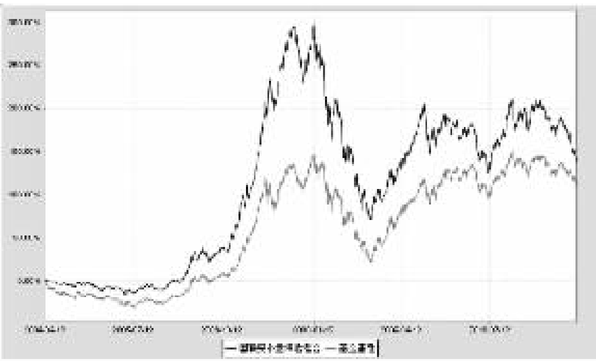
3.2 基金净值表现

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 | -14.89% | 1.00% | -8.79% | 0.86% | -6.10% | 0.14% |

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

国联安德盛小盘精选证券投资基金
累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2004年4月12日至2011年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为(天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%;

2、本基金基金合同于2004年4月12日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外,其他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 | | |
| 邹新进 | 本基金基金经理、研究部副总监 | 2010-3-6 | - | 7年(自2004年起) | 邹新进先生,硕士。邹新进先生于2004年7月加盟中信建投证券有限责任公司(前身为华夏证券有限责任公司)任分析师。2007年7月加入国联安基金管理有限公司,历任高级研究员、基金经理助理,现任研究部副总监,2010年3月起担任本基金基金经理。 |

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 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》、《国联安德盛小盘精选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》(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

截止至本报告期末,本基金管理人旗下共有14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、国联安主题驱动股票型证券投资基金、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金、国联安信心增益债券型证券投资基金、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安货币市场证券投资基金和国联安优选行业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

第三季度A股市场延续下跌趋势,期间几乎没有明显的反弹,但市场风格与第一季度相比又略有转变,由于市场较弱,板块以普跌为主,其中弹性较大的周期板块跌幅较大。

本基金在仓位上没有太大变化。在行业配置上,本基金主要按照季度初的投资思路重点配置在低估值的金融地产类和高景气且估值不高的建材和客车等行业个股上,同时适当配置一些跌幅较大的消费股。但配置的个股及转债下跌,使得本基金的表现不甚理想。

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-14.89%,同期业绩比较基准收益率为-8.79%。

### §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 | 1,226,810,379.20 | 68.56 |
| | 其中:股票 | 1,226,810,379.20 | 68.56 |
| 2 | 固定收益投资 | 420,384,870.76 | 23.49 |
| | 其中:债券 | 420,384,870.76 | 23.49 |
| | 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 | 136,260,137.99 | 7.61 |
| 6 | 其他各项资产 | 6,025,540.65 | 0.34 |
| 7 | 合计 | 1,789,480,928.60 | 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 | 0.00 | 0.00 |
| B | 采掘业 | 64,722,243.55 | 3.68 |
| C | 制造业 | 613,293,541.62 | 34.87 |
| C0 | 食品、饮料 | 162,612,292.03 | 9.25 |
| 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 | 11,180,000.00 | 0.64 |
| C5 | 电子 | 52,882,126.18 | 3.01 |
| C6 | 金属、非金属 | 101,007,460.08 | 5.74 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 276,446,314.88 | 15.72 |
| C8 | 医药、生物制品 | 9,165,348.45 | 0.52 |
| 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 | 0.00 | 0.00 |
| F | 交通运输、仓储业 | 16,050,000.00 | 0.91 |
| G | 信息技术业 | 77,341,798.20 | 4.40 |
| H | 批发和零售贸易 | 92,539,812.20 | 5.26 |
| I | 金融、保险业 | 92,975,686.20 | 5.29 |
| J | 房地产业 | 148,637,985.60 | 8.45 |
| K | 社会服务业 | 0.00 | 0.00 |
| L | 传播与文化产业 | 47,350,311.83 | 2.69 |
| M | 综合类 | 73,899,000.00 | 4.20 |
| | 合计 | 1,226,810,379.20 | 69.76 |

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 | 600066 | 宇通客车 | 5,526,572 | 108,818,202.68 | 6.19 |
| 2 | 600176 | 中国玻纤 | 5,195,857 | 101,007,460.08 | 5.74 |
| 3 | 300171 | 东富龙 | 2,063,331 | 88,723,233.00 | 5.04 |
| 4 | 600157 | 永泰能源 | 5,100,000 | 73,899,000.00 | 4.20 |
| 5 | 600827 | 友谊股份 | 4,400,000 | 68,640,000.00 | 3.90 |
| 6 | 000063 | 中兴通讯 | 3,600,000 | 68,040,000.00 | 3.87 |
| 7 | 000848 | 承德露露 | 4,000,000 | 63,760,000.00 | 3.63 |
| 8 | 000729 | 燕京啤酒 | 4,179,928 | 61,528,540.16 | 3.50 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 4,500,000 | 49,770,000.00 | 2.83 |
| 10 | 600383 | 金地集团 | 10,000,000 | 48,700,000.00 | 2.77 |

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 | 50,128,735.66 | 2.85 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 191,748,945.10 | 10.90 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 178,507,190.00 | 10.15 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 420,384,870.76 | 23.90 |

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 | 113001 | 中行转债 | 800,000 | 72,792,000.00 | 4.14 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 820,000 | 71,676,200.00 | 4.08 |
| 3 | 010112 | 21国债⑿ | 300,000 | 30,054,000.00 | 1.71 |
| 4 | 126005 | 07武钢债 | 296,290 | 29,122,344.10 | 1.66 |
| 5 | 126016 | 08宝钢债 | 318,420 | 28,052,802.00 | 1.60 |

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。

5.8.2 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 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,834,500.81 |
| 2 | 应收证券清算款 | 0.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,170,486.50 |
| 5 | 应收申购款 | 0.00 |
| 6 | 其他应收款 | 20,553.34 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,025,540.65 |

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 | 113001 | 中行转债 | 72,792,000.00 | 4.14 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 71,676,200.00 | 4.08 |
| 3 | 110012 | 海运转债 | 20,100,990.00 | 1.14 |
| 4 | 110013 | 国投转债 | 13,938,000.00 | 0.79 |

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 | 2,481,658,028.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 7,431,789.74 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 47,642,267.04 |
| 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 | 2,441,447,551.66 |

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 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小盘精选证券投资基金设立的文件
2、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》
3、《国联安德盛小盘精选证券投资基金招募说明书》
4、《国联安德盛小盘精选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

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

7.3 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**
**二〇一一年十月二十六日**

---

# 国联安德盛精选股票证券投资基金

## 2011 第三季度 报告

2011年9月30日

**基金管理人:国联安基金管理有限公司**
**基金托管人:华夏银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一一年十月二十六日**

### §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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10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2011年7月1日起至9月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国联安精选股票 |
| 基金主代码 | 257020 |
| 前端交易代码 | 257020 |
| 后端交易代码 | 257021 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年12月28日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,083,371,764.23份 |
| 投资目标 | 通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来获得长期稳定的收益。 |
| 投资策略 | 本基金是股票型基金,在股票投资上主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时,适度把握宏观经济情况进行资产配置。具体来说,本基金通过以下步骤进行股票选择:首先,通过ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力,通过WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本;其次,将公司的获利能力和资本成本指标相结合,选择出创造价值的公司;最后,根据公司的成长能力和估值指标,选择股票,构建股票组合。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数×85%+上证国债指数×15% |
| 风险收益特征 | 中高风险,较高的预期收益。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 华夏银行股份有限公司 |

### §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(2011年7月1日-2011年9月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -140,025,936.72 |
| 2.本期利润 | -263,245,622.12 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0869 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,304,296,979.12 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.747 |

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。

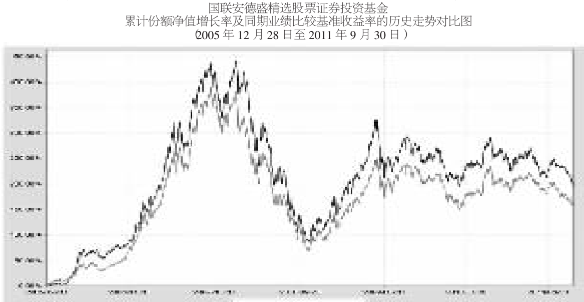
3.2 基金净值表现

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 | -10.11% | 0.86% | -12.89% | 1.12% | 2.78% | -0.26% |

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

国联安德盛精选股票证券投资基金
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2005年12月28日至2011年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为沪深300指数×85%+上证国债指数×15%;

2、本基金基金合同于2005年12月28日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,2006年6月28日建仓期结束当日除股票投资比例略高于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定;

3、本基金于2006年6月17日已基本建仓完毕,各项资产配置比例自该日起符合基金合同的约定。由于2006年6月28日有大额赎回从而导致股票投资比例当日被动超标,本基金已于2006年6月29日及时调整完毕。

### §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 | | |
| 魏东 | 本基金基金经理、兼任总经理助理和投资总监 | 2009-9-30 | - | 14年(自1997年起) | 魏东先生,复旦大学经济学硕士,曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司;2003年1月加盟华宝兴业基金管理公司,先后担任交易部总经理、宝康灵活配置基金和先进成长基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司,现任公司总经理助理及投资总监,2009年9月起担任本基金基金经理,2009年12月至2011年8月兼任国联安主题驱动股票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 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》、《国联安德盛精选股票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》(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

截止至本报告期末,本基金管理人旗下共有14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、国联安主题驱动股票型证券投资基金、国联安双禧中证100指数分级证券投资基金、国联安信心增益债券型证券投资基金、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安货币市场证券投资基金和国联安优选行业股票型证券投资基金。

本基金和国联安主题驱动股票型证券投资基金为股票成长型,为投资风格相似的投资组合。2011年第三季度,本基金和国联安主题驱动股票型证券投资基金的收益率分别为-10.11%和-10.21%,差值为0.10%,无明显差异。

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

出于对国内经济可能大幅放缓和海外债务错综复杂的担心,本基金在第三季度采取了较为谨慎的应对措施。一方面,本基金明显降低了整体股票的持仓水平,增加了现金比例;另一方面,在配置上逐步降低周期类板块的比重,并同时增加消费类板块的持仓。本阶段本基金更重视自下而上的选择,对一些我们长线看好的成长品种继续持有。从调整的效果来看,虽然本基金在大盘下跌的过程中,由于仓位相对较低,在一定程度上控制了系统风险,但基于个股选择的因素,导致本基金未取得明显的超额收益。

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-10.11%,同期业绩比较基准收益率为-12.89%。

### §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 | 1,428,893,128.80 | 61.27 |
| | 其中:股票 | 1,428,893,128.80 | 61.27 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 189,000,483.50 | 8.10 |
| | 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 | 710,984,704.01 | 30.49 |
| 6 | 其他各项资产 | 3,275,895.65 | 0.14 |
| 7 | 合计 | 2,332,154,211.96 | 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 | - | - |
| B | 采掘业 | 267,944,500.00 | 11.63 |
| C | 制造业 | 810,834,010.00 | 35.19 |
| C0 | 食品、饮料 | 3,811,800.00 | 0.17 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 91,450,710.00 | 3.97 |
| C5 | 电子 | 195,689,400.00 | 8.49 |
| C6 | 金属、非金属 | 16,155,000.00 | 0.70 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 55,417,000.00 | 2.40 |
| C8 | 医药、生物制品 | 325,978,500.00 | 14.15 |
| C99 | 其他制造业 | 122,331,600.00 | 5.31 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 84,270,368.80 | 3.66 |
| H | 批发和零售贸易 | 26,662,000.00 | 1.16 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 53,216,000.00 | 2.31 |
| K | 社会服务业 | 185,966,250.00 | 8.07 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,428,893,128.80 | 62.02 |

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 | 300142 | 沃森生物 | 3,120,000 | 170,976,000.00 | 7.42 |
| 2 | 000069 | 华侨城A | 22,500,000 | 143,775,000.00 | 6.24 |
| 3 | 600612 | 老凤祥 | 4,230,000 | 122,331,600.00 | 5.31 |
| 4 | 600216 | 浙江医药 | 3,800,000 | 99,522,000.00 | 4.32 |
| 5 | 300102 | 乾照光电 | 3,900,000 | 90,558,000.00 | 3.93 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 2,200,000 | 87,428,000.00 | 3.79 |
| 7 | 002155 | 辰州矿业 | 3,200,000 | 84,192,000.00 | 3.65 |
| 8 | 600547 | 山东黄金 | 2,000,000 | 77,740,000.00 | 3.37 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 3,900,000 | 73,710,000.00 | 3.20 |
| 10 | 600489 | 中金黄金 | 3,000,000 | 66,840,000.00 | 2.90 |

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名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。

5.8.2 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 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 3,043,348.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 197,626.58 |
| 5 | 应收申购款 | 34,920.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,275,895.65 |

5.8.4 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在转股期内的可转债。

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 | 2,773,759,230.38 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 360,733,984.04 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 51,121,450.19 |
| 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 | 3,083,371,764.23 |

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 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精选股票证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安德盛精选股票证券投资基金基金合同》
3、《国联安德盛精选股票证券投资基金招募说明书》
4、《国联安德盛精选股票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

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

7.3 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**
**二〇一一年十月二十六日**