# 国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

## 2011 第四季度 报告

2011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:二〇一二年一月十九日**

§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2012年1月17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 | 国联安安心成长混合 |
| 基金主代码 | 253010 |
| 交易代码 | 253010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年7月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 91,624,184.53份 |
| 投资目标 | 全程风险预算,分享经济成长,追求绝对收益。 |
| 投资策略 | 本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次通过全程的风险预算,结合数量化的金融工程模型,根据市场以及基金超额收益率的情况,进行资产配置、行业配置和不同种类债券的配置。第二个层次,在股票投资方面,以价值选股为原则,主要选取基本面好、流动性强,价值被低估的公司,在行业配置基础上进行组合管理;在债券投资方面,注重风险管理,追求稳定收益,基于对中长期宏观形势与利率走势的分析进行久期管理与类属配置,并适量持有可转换债券来构建债券组合。 |
| 业绩比较基准 | 为"德盛安心成长线","德盛安心成长线"的确定方式为在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。 |
| 风险收益特征 | 中低风险的基金产品,追求长期的稳定的收益。 |
| 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10月1日-2011年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -1,273,570.31 |
| 2.本期利润 | -829,444.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0090 |
| 4.期末基金资产净值 | 62,973,133.26 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.687 |

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

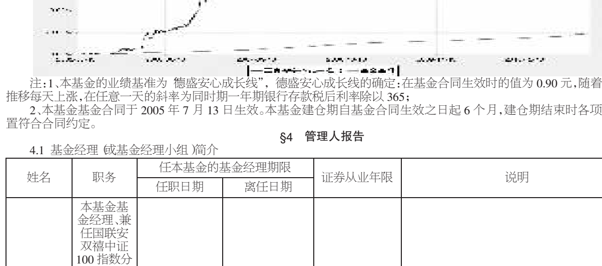
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去3个月 | -1.29% | 0.45% | 0.83% | 0.01% | -2.12% | 0.44% |

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

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

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

(2005年7月13日至2011年12月31日)



注:1、本基金的业绩基准为"德盛安心成长线",德盛安心成长线的确定:在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365;

2、本基金基金合同于2005年7月13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 | | |
| 黄欣 | 本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理 | 2010-5-27 | - | 9年(自2002年起) | 黄欣先生,伦敦经济学院会计金融专业硕士,于2003年10月加入国联安基金管理有限公司,历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理,2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理,2010年5月起兼任本基金基金经理,2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任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》、《国联安德盛安心成长混合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

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4季度,宏观经济继续呈现下滑趋势,经济复苏乏力。虽然以CPI、PPI为代表的物价指数同比增速有所回落,但企业利润增速持续回落,整个经济初步呈现出通缩的局面。资金出现外流迹象,外汇占款减少,M1、M2同比增速继续下滑,资本市场缺乏新的资金注入,股市表现不甚理想。从各个板块表现来看,第4季度金融、铁路、传媒等行业表现较好,有色、化工、煤炭等行业表现不甚理想。

2011年第4季度,本基金在投资操作上,出于对宏观经济下滑的考虑,本基金依旧保持较低的股票仓位,持仓股票以低估值、稳定增长类的股票为主,相应减少了投资操作的频率,并以小额仓位适当参与股市反弹,把握波段性的投资机会;在债券投资方面,考虑到之前可转债资产整体的大幅下跌,本基金小幅增加了该投资品种的配置,此外本基金将部分资金投资于逆回购交易。

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-1.29%,同期业绩比较基准收益率为0.83%。

§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 | 17,143,307.08 | 26.80 |
| | 其中:股票 | 17,143,307.08 | 26.80 |
| 2 | 固定收益投资 | 14,366,496.60 | 22.46 |
| | 其中:债券 | 14,366,496.60 | 22.46 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 8,000,000.00 | 12.51 |
| | 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 | 23,703,665.72 | 37.06 |
| 6 | 其他各项资产 | 743,253.50 | 1.16 |
| 7 | 合计 | 63,956,722.90 | 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 | 179,100.00 | 0.28 |
| B | 采掘业 | 860,100.00 | 1.37 |
| C | 制造业 | 7,622,910.39 | 12.11 |
| C0 | 食品、饮料 | 1,308,640.00 | 2.08 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 591,286.00 | 0.94 |
| 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 | 641,224.39 | 1.02 |
| C5 | 电子 | 502,020.00 | 0.80 |
| C6 | 金属、非金属 | 0.00 | 0.00 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,421,200.00 | 2.26 |
| C8 | 医药、生物制品 | 3,158,540.00 | 5.02 |
| 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 | 415,288.00 | 0.66 |
| F | 交通运输、仓储业 | 0.00 | 0.00 |
| G | 信息技术业 | 315,500.00 | 0.50 |
| H | 批发和零售贸易 | 0.00 | 0.00 |
| I | 金融、保险业 | 5,877,640.00 | 9.33 |
| J | 房地产业 | 647,500.00 | 1.03 |
| K | 社会服务业 | 1,225,268.69 | 1.95 |
| L | 传播与文化产业 | 0.00 | 0.00 |
| M | 综合类 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 17,143,307.08 | 27.22 |

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 | 601288 | 农业银行 | 900,000 | 2,358,000.00 | 3.74 |
| 2 | 600594 | 益佰制药 | 140,000 | 2,349,200.00 | 3.73 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 180,000 | 1,747,800.00 | 2.78 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 48,000 | 980,640.00 | 1.56 |
| 5 | 000400 | 许继电气 | 49,000 | 948,150.00 | 1.51 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 26,000 | 895,440.00 | 1.42 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 70,000 | 876,400.00 | 1.39 |
| 8 | 600079 | 人福医药 | 42,000 | 809,340.00 | 1.29 |
| 9 | 600138 | 中青旅 | 45,000 | 677,700.00 | 1.08 |
| 10 | 600348 | 阳泉煤业 | 40,000 | 607,200.00 | 0.96 |

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 | 2,529,826.60 | 4.02 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 4,209,950.00 | 6.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 7,626,720.00 | 12.11 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 14,366,496.60 | 22.81 |

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 | 110015 | 石化转债 | 36,000 | 3,618,360.00 | 5.75 |
| 2 | 110007 | 博汇转债 | 24,000 | 2,305,920.00 | 3.66 |
| 3 | 112007 | 09金街01 | 20,000 | 1,988,000.00 | 3.16 |
| 4 | 113001 | 中行转债 | 18,000 | 1,702,440.00 | 2.70 |
| 5 | 010107 | 21国债(7) | 15,000 | 1,612,200.00 | 2.56 |

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 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 381,215.60 |
| 3 | 应收股利 | 0.00 |
| 4 | 应收利息 | 109,862.52 |
| 5 | 应收申购款 | 296.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 1,879.23 |
| 9 | 合计 | 743,253.50 |

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 | 110015 | 石化转债 | 3,618,360.00 | 5.75 |
| 2 | 110007 | 博汇转债 | 2,305,920.00 | 3.66 |
| 3 | 113001 | 中行转债 | 1,702,440.00 | 2.70 |

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 | 91,975,497.26 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 481,910.51 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 833,223.24 |
| 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 | 91,624,184.53 |

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 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安心成长混合型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》

3、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安德盛安心成长混合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

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**
**二〇一二年一月十九日**

# 国联安德盛红利股票证券投资基金

## 2011 第四季度 报告

2011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:招商银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一二年一月十九日**

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月17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 | 国联安红利股票 |
| 基金主代码 | 257040 |
| 前端交易代码 | 257040 |
| 后端交易代码 | 257041 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年10月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 62,437,482.14份 |
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于盈利稳定增长的、具有较高股息收益率的、财务稳健的上市公司,追求稳定的股息收入和长期的资本增值。 |
| 投资策略 | (一)资产配置策略<br>本基金属于股票型基金,在运作期间,本基金将分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析,在股票与债券资产之间进行策略性资产配置,以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上,优化投资组合,规避或控制市场风险,提高基金收益率;<br>(二)行业及股票投资策略<br>本基金将个股选择做为投资重点。行业配置是在股票选择的基础之上形成。即我们在构建组合的过程中,会首先优选出具有较高分红预期的公司。在此基础上,通过对经济周期、产业环境、产业政策和行业竞争格局的分析和预测,确定宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,同时考虑行业的成长性,得出各行业的相对投资价值与投资时机,结合这些行业评估值来确定上述公司的配置比例。我们主要对行业经济基本面因素、上市公司基本面因素以及证券市场交易信息这三类相关因素进行分析,最终形成本基金的行业配置。<br>(三)个股选择<br>本基金采用定量和定性相结合的个股精选策略,精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象,以增强本基金的股息收益和资本增值能力。本基金投资于红利型股票的比例不低于本基金持有的股票资产的80%。<br>(四)债券投资<br>基于策略性资产配置的需要,本基金在预期股票市场阶段性回报率低于债券资产回报率时,本基金将会将一部分基金资产投资于国债、金融债、中央银行票据及企业债券等固定收益资产。本基金在固定收益证券投资与研究方面,实行投资策略研究专业化分工制度,专业研究人员分别从利率、信用风险等角度,提出独立的投资策略建议,经固定收益投资团队讨论,并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略,具体包括利率策略、信用策略、债券选择策略等。本基金在固定收益证券总体指导性投资策略基础上,结合本基金流动性要求的特点,形成具体投资策略。<br>(五)权证投资<br>权证投资的包括两个方面:一是基金经理提出投资要求;二是数量策略研究员提供投资建议。<br>基金经理提出投资权证的要求,相关的数量策略研究员应该根据投资目的进行相关的投资价值分析,作为投资决策的依据。对于作为基础证券备选方案的权证,研究基础证券与权证在风险和收益方面的区别;对于在组合管理层面利用权证调整组合风险收益特征的投资,测算所选权证与投资组合的相关性及其稳定性,并研究此项投资的风险因素等。 |
| 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 | 本基金是股票型基金,属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险的品种,本基金的风险与预期收益都要高于混合型基金和债券型基金。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招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10月1日-2011年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -4,137,368.87 |
| 2.本期利润 | -4,270,249.58 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0677 |
| 4.期末基金资产净值 | 48,248,033.39 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.773 |

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

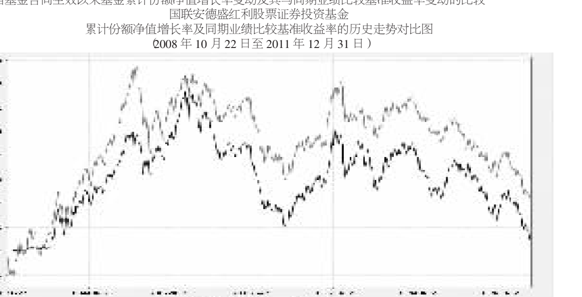
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去3个月 | -8.09% | 1.23% | -7.05% | 1.12% | -1.04% | 0.11% |

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

国联安德盛红利股票证券投资基金

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

(2008年10月22日至2011年12月31日)



注:1、本基金的业绩基准为沪深300指数×80%+上证国债指数×20%;

2、本基金基金合同于2008年10月22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、兼任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理 | 2010-5-27 | - | 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月起担任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理,2010年5月起兼任本基金基金经理。 |

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》、《国联安德盛红利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。

国联安德盛优势股票证券投资基金、本基金和国联安优选行业股票型证券投资基金为股票价值型,为投资风格相似的投资组合。2011年第四季度,国联安德盛优势股票证券投资基金、本基金和国联安优选行业股票型证券投资基金的收益率分别为-5.92%、-8.09%和-7.26%,差异未超过5%。

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4季度是A股损失较大的一个季度,宏观经济和企业利润下滑趋势较为明显,资金面依然较为紧张。本基金在第四季度降低了仓位,然而在全市场大幅下跌的背景下,本基金的净值依然受到了一定程度的影响。

就目前而言,市场估值中枢——银行等传统权重蓝筹股价位较低,高成长类股票估值已日趋合理,但短期基本面趋势可能持续压制股价,最好的买点或许仍需等待。在此阶段,本基金拟将保持适度的仓位,配置一些基本面稳定、中长期潜力较大的稳定增长型股票,并以基本面变动趋势为主线,关注长期增长潜力较大的高成长类股票,争取在中长期内获得一定的收益。

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-8.09%,同期业绩比较基准收益率为-7.05%。

§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 | 44,435,851.24 | 87.43 |
| | 其中:股票 | 44,435,851.24 | 87.43 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 5,639,283.11 | 11.10 |
| 6 | 其他各项资产 | 751,404.76 | 1.48 |
| 7 | 合计 | 50,826,539.11 | 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 | 2,694,450.00 | 5.58 |
| B | 采掘业 | 2,994,760.00 | 6.21 |
| C | 制造业 | 25,632,725.09 | 53.13 |
| C0 | 食品、饮料 | 4,605,515.00 | 9.55 |
| 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 | 863,360.00 | 1.79 |
| C5 | 电子 | 7,939,563.75 | 16.46 |
| C6 | 金属、非金属 | 881,220.00 | 1.83 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 4,971,794.30 | 10.30 |
| C8 | 医药、生物制品 | 6,371,272.04 | 13.21 |
| 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 | 5,483,943.02 | 11.37 |
| H | 批发和零售贸易 | 1,896,960.00 | 3.93 |
| I | 金融、保险业 | 2,002,600.00 | 4.15 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 1,899,240.00 | 3.94 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 1,831,173.13 | 3.80 |
| | 合计 | 44,435,851.24 | 92.10 |

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 | 000423 | 东阿阿胶 | 54,500 | 2,340,775.00 | 4.85 |
| 2 | 002415 | 海康威视 | 51,000 | 2,193,000.00 | 4.55 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 340,000 | 2,002,600.00 | 4.15 |
| 4 | 000069 | 华侨城A | 266,000 | 1,899,240.00 | 3.94 |
| 5 | 600694 | 大商股份 | 57,000 | 1,896,960.00 | 3.93 |
| 6 | 000895 | 双汇发展 | 26,500 | 1,853,675.00 | 3.84 |
| 7 | 600805 | 悦达投资 | 148,997 | 1,831,173.13 | 3.80 |
| 8 | 600216 | 浙江医药 | 91,958 | 1,829,044.62 | 3.79 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 106,200 | 1,794,780.00 | 3.72 |
| 10 | 002086 | 东方海洋 | 136,650 | 1,776,450.00 | 3.68 |

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 | 750,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,108.61 |
| 5 | 应收申购款 | 296.15 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 751,404.76 |

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处于转股期的可转换债券。

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 | 63,822,547.38 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 375,967.06 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 1,761,032.30 |
| 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 | 62,437,482.14 |

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红利股票证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安德盛红利股票证券投资基金基金合同》

3、《国联安德盛红利股票证券投资基金招募说明书》

4、《国联安德盛红利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**
**二〇一二年一月十九日**

# 国联安德盛精选股票证券投资基金

## 2011 第四季度 报告

2011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:华夏银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一二年一月十九日**

§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2012年1月17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 | 3,035,416,849.65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10月1日-2011年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -101,516,422.15 |
| 2.本期利润 | -217,310,293.38 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0701 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,049,231,038.59 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.675 |

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

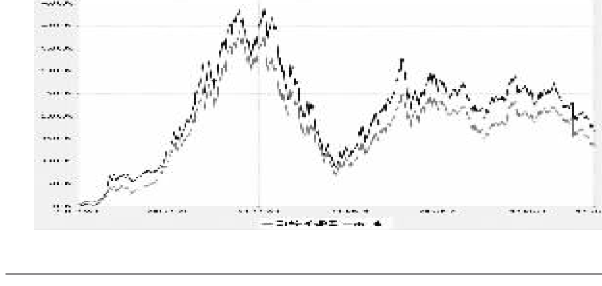
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去3个月 | -9.64% | 1.19% | -7.57% | 1.20% | -2.07% | -0.01% |

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及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12月31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、兼任副总经理和投资总监 | 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,先后担任总经理助理、投资总监的职务。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。2011年11月起,担任公司副总经理。 |

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年第四季度,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-9.64%和-5.12%,差值为4.52%,差异未超过5%。

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

本报告期内,我们所采取的基本策略是尽可能地回避风险、并寻找较为有利的投资机会,但由于我们进场时间相对过早,导致本基金业绩在上证综指2300点后的一波下跌中受到了一定的影响。

由于投资者对企业赢利加速下滑的担心,加上各类非流通股的减持以及市场流动性不足等原因,导致第四季度市场走势不尽如人意。自上而下而言,企业赢利低点尚未完全显现,欧洲债务问题也难以预测,国内拉动经济增长的新引擎也没有着落;但自下而上来看,不少企业估值水平已经在某种程度上反应了市场投资者的预期,我们认为自下而上选股的机会或将逐步到来,未来我们将更为积极地寻找一些投资机会。

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-9.64%,同期业绩比较基准收益率为-7.57%。

§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 | 1,846,067,018.68 | 89.36 |
| | 其中:股票 | 1,846,067,018.68 | 89.36 |
| 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 | 49,000,273.50 | 2.37 |
| | 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 | 167,068,877.27 | 8.09 |
| 6 | 其他各项资产 | 3,762,399.25 | 0.18 |
| 7 | 合计 | 2,065,898,568.70 | 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 | 7,743,000.00 | 0.38 |
| B | 采掘业 | 271,532,000.00 | 13.25 |
| C | 制造业 | 962,843,933.28 | 46.99 |
| C0 | 食品、饮料 | 34,783,320.67 | 1.70 |
| 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 | 115,957,200.00 | 5.66 |
| C5 | 电子 | 207,843,072.60 | 10.14 |
| C6 | 金属、非金属 | 3,654,948.83 | 0.18 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 168,545,456.29 | 8.22 |
| C8 | 医药、生物制品 | 306,779,934.89 | 14.97 |
| C99 | 其他制造业 | 125,280,000.00 | 6.11 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 5,611,500.00 | 0.27 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 90,428,000.00 | 4.41 |
| H | 批发和零售贸易 | - | - |
| I | 金融、保险业 | 180,632,922.36 | 8.81 |
| J | 房地产业 | 40,000,000.00 | 1.95 |
| K | 社会服务业 | 235,041,000.00 | 11.47 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 52,234,663.04 | 2.55 |
| | 合计 | 1,846,067,018.68 | 90.08 |

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 | 000069 | 华侨城A | 23,000,000 | 164,220,000.00 | 8.01 |
| 2 | 300142 | 沃森生物 | 3,120,049 | 142,305,434.89 | 6.94 |
| 3 | 600612 | 老凤祥 | 4,800,000 | 125,280,000.00 | 6.11 |
| 4 | 600315 | 上海家化 | 2,700,000 | 92,043,000.00 | 4.49 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 7,200,840 | 90,154,516.80 | 4.40 |
| 6 | 600216 | 浙江医药 | 4,150,000 | 82,543,500.00 | 4.03 |
| 7 | 002415 | 海康威视 | 1,800,000 | 77,400,000.00 | 3.78 |
| 8 | 002155 | 辰州矿业 | 3,800,000 | 76,266,000.00 | 3.72 |
| 9 | 600489 | 中金黄金 | 4,350,000 | 76,168,500.00 | 3.72 |
| 10 | 601888 | 中国国旅 | 2,700,000 | 70,821,000.00 | 3.46 |

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 | 3,509,266.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 64,241.03 |
| 5 | 应收申购款 | 159,446.79 |
| 6 | 其他应收款 | 29,445.08 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,762,399.25 |

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 | 3,083,371,764.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 208,477,657.51 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 256,432,572.09 |
| 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 | 3,035,416,849.65 |

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**
**二〇一二年一月十九日**