国联安德盛优势股票证券投资基金

2011 年度报告摘要

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:二〇一二年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计,毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国联安优势股票	
基金主代码	257030	
交易代码	257030	257031
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年 1 月 24 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	
报告期末基金份额总额	835,146,658.40 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行的债券,在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,实现基金资产的持续、稳定增值。
投资策略	1、资产配置策略 本基金属于股票型基金,在运作期间,将会结合宏观经济、政策、资金供求、市场波动周期等因素的判断,以及各类证券风险收益特征的相对变化,适度地动态调整股票资产、债券资产和货币市场工具的比例,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。 2、行业及股票投资策略 本基金将优选个股做为投资重点。行业配置是在股票优选的基础之上形成。即我们在构建组合的过程中,会首先优选出具有竞争优势的公司。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优势公司的配置比例。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。 3、个股选择 个股的选择的流程如下: (1)通过毛利率,费用指标、资产负债率等财务指标选择出备选库。 (2)在备选股的基础上,本公司研究员通过对公司的实地调研及安联的草根研究方法对上市公司的成长性等进行深入的分析构建核心股票库。 (3)在核心股票库的基础上通过一系列衡量上市公司的优势指标(如每股资源储量,研发费用占销售收入比等)对投资标的进一步优选,构建本公司的投资组合。 总体而言,本基金的投资标的是指那些具备估值潜力又有强大竞争优势的上市公司。 4、债券投资 本基金将采取"自上而下"投资策略,对各类债券进行合理的配置。本基金将深入分析国内外宏观经济形势、国内财政货币政策以及结构调整因素对债券市场的影响,判断债券市场的走势,采取相应的资产配置策略。本基金在债券投资组合构建和管理过程中,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略等积极的投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。 5、权证投资 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。 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×70%+上证国债指数×30%
风险收益特征	较高的预期收益和风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	张燕
	联系电话	021-38992806	0755-83199084
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95555
传真		021-50151582	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-19,084,552.21	-54,599,035.64	336,066,771.68
本期利润	-192,676,131.81	-59,763,969.17	600,918,573.25
加权平均基金份额本期利润	-0.2062	-0.0592	0.4723
本期基金份额净值增长率	-20.48%	-3.84%	56.08%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1904	0.0399	0.2582
期末基金资产净值	676,136,095.52	1,043,166,690.93	1,367,247,607.14
期末基金份额净值	0.810	1.040	1.258

注:1、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。

2、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。

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

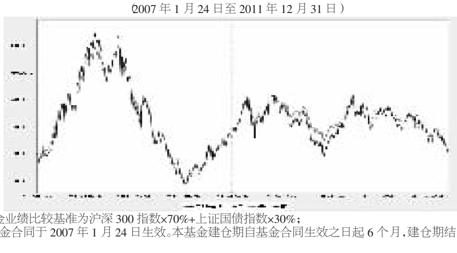
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	-5.92%	1.16%	-6.01%	0.98%	0.09%	0.18%
过去六个月	-16.41%	1.11%	-15.92%	0.95%	-0.49%	0.16%
过去一年	-20.48%	1.22%	-16.91%	0.91%	-3.57%	0.31%
过去三年	19.35%	1.50%	25.20%	1.17%	-5.85%	0.33%
过去五年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	4.47%	1.74%	6.40%	1.51%	-1.93%	0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国联安德盛优势股票证券投资基金
份额累计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
(2007 年 1 月 24 日至 2011 年 12 月 31 日)

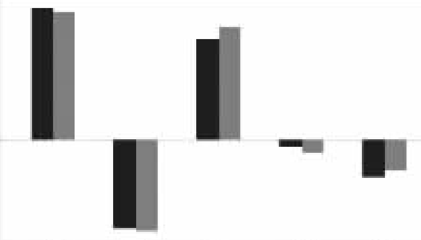


注:1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%;

2、本基金基金合同于 2007 年 1 月 24 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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安德盛优势股票证券投资基金
自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较



注:* 基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	–	–	–	–	–
2010年	1.810	114,796,322.39	68,849,247.64	183,645,570.03	–
2009年	–	–	–	–	–
合计	1.810	114,796,322.39	68,849,247.64	183,645,570.03	–

注:本基金于 2011 年 3 月 23 日实施的利润分配,收益分配基准日为 2010 年 12 月 31 日,即实施的是 2010 年度的利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司,其中方股东为国泰君安证券股份有限公司,是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一;外方股东为德国安联集团,是全球顶级综合性金融集团之一。本报告期内公司管理着十四只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队,借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验,结合本地投资研究与客户服务的成功实践,秉持"稳健、专业、卓越、信赖"的经营理念,力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韦明亮	本基金基金经理、兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金基金经理、研究副总监	2011-04-23	–	11年(自 2001 年起)	韦明亮先生,经济学硕士。曾任上海升华投资有限公司研究员,上海国禾投资有限公司研究员,光大证券研究所研究员,2006 年 3 月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级分析师。2006 年 11 月加入光大证券股份有限公司,先后担任证券投资部投资经理、证券投资部执行董事。2010 年 5 月起加入国联安基金管理有限公司,担任研究副总监,2010 年 12 月起担任国联安主题驱动股票型证券投资基金基金经理。2011 年 4 月起兼任本基金基金经理。
陈苏桥	本基金基金经理	2007-08-21	2011-04-23	13年(自 1999 年起)	陈苏桥先生,清华大学经济学硕士。曾任职于上海瑞士达国际贸易有限公司,1999 年 5 月加入华安基金管理有限公司从事投资、研究工作。2003 年 9 月至 2005 年 5 月,担任安瑞证券投资基金基金经理。2007 年 1 月加入国联安基金管理有限公司,曾任研究部总监,2007 年 8 月至 2011 年 4 月担任本基金基金经理,2009 年 8 月至 2010 年 12 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》、《国联安德盛优势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资产,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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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、国联安德盛红利股票证券投资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。截至 2011 年 12 月 31 日,本基金、国联安德盛红利股票证券投资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 -20.48%、-23.92 %和 -14.40%,本基金和国联安德盛红利股票证券投资基金差异未超过 5%,国联安优选行业股票型证券投资基金成立未满一年缺乏可比性。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年,随着宏观经济和企业盈利的不断下滑,货币政策的紧缩导致市场利率的上升,以及严厉的地产调控,市场虽然中间有过几次反弹,但整体呈现下跌趋势。在板块方面,盈利增长确定的银行和消费品等行业获得了不错的超额收益。

在操作方面,本基金在仓位方面,总体基本上跟上了市场节奏,为基金贡献了一定收益,在板块配置方面,在大部分时间内较多配置银行、消费品板块的个股,另外,在年初本基金配置了一定的周期性行业个股,使得在行业配置方面也相对获得了一定超额收益。

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-20.48%,同期业绩比较基准收益率为-16.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年,宏观经济下滑趋势至少将在 2012 年第 1 季度延续,与此对应,企业盈利也将面临严峻考验;由于宏观政策的预调和微调立场可能会持续,使得市场流动性的改善力度存在一定的限制,当然其持续时间也有待观察;此外,经历了长时间下跌,市场的绝对估值水平处于较低水平。综合而言,我们认为,市场在上半年可能会有一定机会出现,是否有更大的系统性机会需要观察宏观经济的进一步发展,与此同时也要关注地产调控政策的未来走向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成,并根据业务分工履行相应的职责,所有成员都具有丰富的专业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过,数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致,估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策,公司和基金托管银行有充分沟通,积极商讨达成一致意见;对于估值结果,公司和基金托管银行有详细的核对流程,达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、报告期内应分配的金额

根据法律法规的规定及《国联安德盛优势股票证券投资基金基金合同》的约定,本基金报告期内无应分配金额。

2、报告期内已实施的利润分配情况

本报告期内本基金无已实施的本年度的利润分配。

本基金于 2011 年 3 月 23 日实施了 2010 年度的利润分配,此次分红的收益分配基准日为 2010 年 12 月 31 日,红利发放日为 2011 年 3 月 23 日,按每 10 份基金份额 0.21 元派发红利,共发放红利 20,614,561.79 元,其中以现金形式发放 12,447,089.32 元,以红利再投资形式发放 8,167,472.47 元。

3、应分配但尚未实施的利润的相关金额或分配安排

本基金无应分配但尚未实施的利润。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

毕马威华振会计师事务所负责项目的注册会计师王国蓓、戴丽对国联安德盛优势股票证券投资基金的年度报表出具了无保留意见的审计报告(报告编号:KPMG-B(2012)AR No. 0068)。具体内容详见本基金年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国联安德盛优势股票证券投资基金
报告截止日:2011 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	105,165,661.73	62,360,739.83
结算备付金		1,372,429.62	2,720,616.27
存出保证金		1,760,000.00	1,792,545.87
交易性金融资产	7.4.7.2	572,459,854.17	985,397,515.18
其中:股票投资		572,459,854.17	937,232,188.08
基金投资		–	–
债券投资		–	48,165,327.10
资产支持证券投资		–	–
衍生金融资产	7.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	–	–
应收证券清算款		–	–
应收利息	7.4.7.5	24,594.52	67,251.40
应收股利		–	–
应收申购款		985.81	84,353.65
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	–	–
资产总计		680,783,525.85	1,052,423,022.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	3,305,211.38
应付赎回款		1,193,921.29	1,040,977.66
应付管理人报酬		885,046.27	1,335,154.01
应付托管费		147,507.73	222,525.65
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	7.4.7.7	516,631.72	1,451,640.51
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	7.4.7.8	1,904,323.32	1,900,822.06
负债合计		4,647,430.33	9,256,331.27
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	835,146,658.40	1,003,167,539.77
未分配利润	7.4.7.10	-159,010,562.88	39,999,151.16
所有者权益合计		676,136,095.52	1,043,166,690.93
负债和所有者权益总计		680,783,525.85	1,052,423,022.20

注:1、报告截止日 2011 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.810 元,基金份额总额 835,146,658.40 份。

2、本摘要中资产负责表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.2 利润表

会计主体:国联安德盛优势股票证券投资基金
本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-167,343,568.64	-30,294,721.78
1.利息收入		925,467.72	1,048,867.85
其中:存款利息收入	7.4.7.11	849,691.97	752,388.36
债券利息收入		75,775.75	281,768.60
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		–	14,710.89
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,190,483.03	-26,267,781.14
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-7,584,195.83	-29,519,411.51
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.4.7.13	6,521,764.60	-2,472,324.00
资产支持证券投资收益		–	–
衍生工具收益	7.4.7.14	–	–
股利收益	7.4.7.15	6,252,914.26	5,723,954.37
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-173,591,579.60	-5,164,933.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	132,060.21	89,125.04
减:二、费用		25,332,563.17	29,469,247.39
1.管理人报酬		13,387,769.29	16,237,923.96
2.托管费		2,231,294.84	2,706,320.64
3.销售服务费		–	–
4.交易费用	7.4.7.17	9,290,757.06	10,100,585.69
5.利息支出		–	–
其中:卖出回购金融资产支出		–	–
6.其他费用	7.4.7.19	422,741.98	424,417.10
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-192,676,131.81	-59,763,969.17

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安德盛优势股票证券投资基金
本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,003,167,539.77	39,999,151.16	1,043,166,690.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-192,676,131.81	-192,676,131.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-168,020,881.37	14,280,979.56	-153,739,901.81
其中:1.基金申购款	38,558,620.43	-2,718,961.68	35,839,658.75
2.基金赎回款	-206,579,501.80	16,999,941.24	-189,579,560.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-20,614,561.79	-20,614,561.79
五、期末所有者权益(基金净值)	835,146,658.40	-159,010,562.88	676,136,095.52
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,086,675,351.51	280,572,255.63	1,367,247,607.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-59,763,969.17	-59,763,969.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-83,507,811.74	-17,778,127.06	-101,285,938.80
其中:1.基金申购款	275,377,787.97	29,335,568.70	304,713,356.67
2.基金赎回款	-358,885,599.71	-47,113,695.76	-405,999,295.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	-163,031,008.24	-163,031,008.24
五、期末所有者权益(基金净值)	1,003,167,539.77	39,999,151.16	1,043,166,690.93

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告序号 7.1 至 7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:邵杰军,主管会计工作负责人:李柯,会计机构负责人:仲晓峰

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国联安德盛优势股票证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会《关于同意国联安德盛优势股票证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]223 号文)批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安德盛优势股票证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2007 年 1 月 24 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 4,462,883,026.84 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安德盛优势股票证券投资基金基金合同》和《国联安德盛优势股票证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,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,债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产占基金资产的 60%-90%;债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的 10%-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数×70%+上证国债指数×30%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安德盛优势股票证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过会计差错。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税,自 2005 年 6 月 13 日起,对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50%计算个人所得税。

(5)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(6)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司("国泰君安")	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司("中德安联")	基金管理人的股东控制的公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	540,291,425.89	8.93%	1,314,765,720.41	20.01%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安	8,230,449.60	10.23%	103,997,301.00	35.11%

7.4.8.1.3 权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	459,243.67	9.12%	–	–
关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	1,117,545.71	20.46%	239,678.73	16.51%

注:股票交易佣金计提标准如下:

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取,并符合行业标准。

根据《证券研究服务协议》,本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证与回购交易的同时,还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,387,769.29	16,237,923.96
其中:支付销售机构的客户维护费	1,725,392.04	2,243,963.21

注:支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,231,294.84	2,706,320.64

注:支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内,基金管理人未投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末(2011 年 12 月 31 日)及上年度末(2010 年 12 月 31 日),除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	105,165,661.73	805,311.46	62,360,739.83	708,616.70

注:本基金通过"招商银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于 2011 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,372,429.62 元。(2010 年:人民币 2,720,616.27 元)

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间,本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2011 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》,证券投资基金参与网下配售,应当承诺获得网下配售的股票持有期限不少于 3 个月,持有期自公开发行的股票上市之日起计算。基金通过网上申购获配的新股,从新股获配日至该新股上市日期间,为流通受限制而不能自由转让的资产。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

本基金本报告期末(2011 年 12 月 31 日)未持有因认购新发或增发而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末(2011 年 12 月 31 日)未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元,因此没有作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元,因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	572,459,854.17	84.09
	其中:股票	572,459,854.17	84.09
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	106,538,091.35	15.65
6	其他各项资产	1,785,580.33	0.26
7	合计	680,783,525.85	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	17,748,393.00	2.62
B	采掘业	–	–
C	制造业	326,110,661.96	48.23
C0	食品、饮料	117,011,178.00	17.31
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	8,121,801.30	1.20
C5	电子	88,606,604.01	13.10
C6	金属、非金属	23,061,868.68	3.41
C7	机械、设备、仪表	64,903,495.97	9.60
C8	医药、生物制品	24,405,714.00	3.61
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	9,802,000.00	1.45
H	批发和零售贸易	47,144,620.31	6.97
I	金融、保险业	81,886,148.64	12.11
J	房地产业	34,217,624.33	5.06
K	社会服务业	42,485,383.93	6.28
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	13,065,022.00	1.93
	合计	572,459,854.17	84.67

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	200,000	38,660,000.00	5.72
2	600016	民生银行	6,000,000	35,340,000.00	5.23
3	000895	双汇发展	418,000	29,239,100.00	4.32
4	000858	五 粮 液	850,000	27,880,000.00	4.12
5	002269	美邦服饰	954,205	24,780,703.85	3.67
6	600267	海正药业	768,200	24,405,714.00	3.61
7	000001	深发展 A	1,500,000	23,385,000.00	3.46
8	601166	兴业银行	1,849,932	23,161,148.64	3.43
9	002344	海宁皮城	988,242	22,363,916.46	3.31
10	002475	立讯精密	625,324	21,823,807.60	3.23

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于国联安基金管理有限公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	146,413,985.40	14.04
2	600585	海螺水泥	102,800,184.91	9.85
3	600031	三一重工	95,117,621.65	9.12
4	600016	民生银行	88,099,582.40	8.45
5	002024	苏宁电器	85,433,480.89	8.19
6	000002	万 科 A	76,958,517.78	7.38
7	601601	中国太保	61,577,231.10	5.90
8	000069	华侨城 A	59,108,934.59	5.67
9	600694	大商股份	53,604,336.96	5.14
10	600309	烟台万华	50,749,825.06	4.86
11	600048	保利地产	49,744,545.16	4.77
12	600519	贵州茅台	46,294,028.26	4.44
13	002269	美邦服饰	45,503,686.75	4.36
14	600104	上海汽车	44,947,393.26	4.31
15	000157	中联重科	42,410,439.58	4.07
16	000858	五 粮 液	41,579,739.94	3.99
17	600339	天利高新	41,549,485.17	3.98
18	000503	海虹控股	41,121,897.60	3.94
19	000829	天音控股	39,081,229.83	3.75
20	002436	兴森科技	38,608,380.20	3.70
21	600157	永泰能源	38,352,518.45	3.68
22	002001	新 和 成	38,070,987.50	3.65
23	002475	立讯精密	36,724,976.05	3.52
24	600395	盘江股份	35,716,282.66	3.42
25	600888	新疆众和	35,459,300.83	3.40
26	000568	泸州老窖	35,152,166.01	3.37
27	002415	海康威视	35,039,376.51	3.36
28	000630	铜陵有色	34,912,842.00	3.35
29	601607	上海医药	34,266,867.19	3.28
30	600176	中国玻纤	32,810,921.00	3.15
31	002344	海宁皮城	31,850,148.22	3.05
32	601318	中国平安	31,821,927.31	3.05
33	600970	中材国际	31,499,433.81	3.02
34	002015	霞客环保	31,246,639.01	3.00
35	601919	中国远洋	30,923,877.59	2.96
36	002535	林州重机	30,261,930.63	2.90
37	000895	双汇发展	30,218,864.01	2.90
38	600489	中金黄金	29,924,829.95	2.87
39	600267	海正药业	29,468,224.23	2.82
40	600383	金地集团	29,181,379.74	2.80
41	000759	中百集团	28,846,936.63	2.77
42	002408	齐翔腾达	27,826,249.68	2.67
43	002563	森马服饰	26,366,751.03	2.53
44	600000	浦发银行	26,035,656.60	2.50
45	002086	东方海洋	25,906,699.36	2.48
46	002481	双塔食品	25,855,840.06	2.48
47	300088	长信科技	25,830,955.98	2.48
48	600376	首开股份	25,436,085.41	2.44
49	600588	用友软件	25,396,862.78	2.43
50	600298	安琪酵母	25,240,349.24	2.42
51	000001	深发展 A	25,171,824.34	2.41
52	600801	华新水泥	23,044,146.10	2.21
53	601101	昊华能源	22,922,575.42	2.20
54	601009	南京银行	22,790,427.72	2.18
55	601888	中国国旅	22,330,712.14	2.14
56	300048	合康变频	21,860,081.70	2.10
57	300115	长盈精密	21,600,051.02	2.07
58	600030	中信证券	21,588,747.59	2.07
59	000937	冀中能源	21,575,086.40	2.07
60	000680	山推股份	21,253,329.73	2.04
61	600582	天地科技	21,135,895.93	2.03
62	601299	中国北车	20,903,604.51	2.00
63	000651	格力电器	20,891,583.80	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600694	大商股份	123,721,662.74	11.86
2	000002	万 科 A	114,808,453.76	11.01
3	601166	兴业银行	112,499,907.75	10.78
4	600585	海螺水泥	101,293,279.43	9.71
5	600031	三一重工	91,632,530.95	8.78
6	002236	大华股份	87,213,572.17	8.36
7	600048	保利地产	81,357,893.17	7.80
8	601318	中国平安	76,795,732.83	7.36
9	600801	华新水泥	76,482,286.56	7.33
10	000755	山西三维	76,024,598.18	7.29
11	002024	苏宁电器	72,640,082.09	6.96
12	601601	中国太保	58,828,972.75	5.64
13	000933	神火股份	56,507,994.75	5.42
14	002015	霞客环保	55,635,678.29	5.33
15	600123	兰花科创	52,220,943.97	5.01
16	600016	民生银行	48,055,996.47	4.61
17	600339	天利高新	46,767,951.41	4.48
18	600104	上海汽车	45,784,661.73	4.39
19	000503	海虹控股	44,914,182.42	4.31
20	002386	天原集团	44,184,708.79	4.24
21	300064	豫金刚石	43,342,678.13	4.15
22	002001	新 和 成	43,280,020.16	4.15
23	000829	天音控股	37,560,885.27	3.60
24	600376	首开股份	37,085,778.02	3.56
25	002415	海康威视	37,078,491.86	3.55
26	000157	中联重科	35,794,565.82	3.43
27	600309	烟台万华	35,570,093.45	3.41
28	601299	中国北车	35,412,251.19	3.39
29	000630	铜陵有色	34,850,892.38	3.34
30	600395	盘江股份	33,661,074.67	3.23
31	000069	华侨城 A	33,431,252.17	3.20
32	000568	泸州老窖	33,037,128.24	3.17
33	000422	湖北宜化	31,893,492.71	3.06
34	600169	太原重工	31,069,451.32	2.98
35	600157	永泰能源	30,742,752.55	2.95
36	002408	齐翔腾达	30,471,481.82	2.92
37	601919	中国远洋	30,119,997.16	2.89
38	600582	天地科技	29,855,941.62	2.86
39	600176	中国玻纤	29,022,113.47	2.78
40	000759	中百集团	28,880,558.00	2.77
41	600383	金地集团	28,401,415.26	2.72
42	300115	长盈精密	27,353,153.47	2.62
43	601607	上海医药	26,406,227.95	2.53
44	600588	用友软件	25,975,473.20	2.49
45	600221	海南航空	25,096,692.61	2.41
46	600489	中金黄金	25,057,414.94	2.40
47	600000	浦发银行	24,246,573.62	2.32
48	002563	森马服饰	23,889,089.27	2.29
49	600970	中材国际	23,630,946.00	2.27
50	000597	东北制药	23,474,887.59	2.25
51	300146	汤臣倍健	22,412,065.50	2.15
52	000937	冀中能源	22,365,983.62	2.14
53	600030	中信证券	21,987,113.91	2.11
54	601101	昊华能源	21,526,105.94	2.06
55	600216	浙江医药	21,262,059.10	2.04
56	600298	安琪酵母	20,884,974.34	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	2,945,957,949.30
卖出股票的收入(成交)总额	3,141,429,206.37

注:不考虑相关交易费用

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,760,000.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	24,594.52
5	应收申购款	985.81
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,785,580.33

8.9.4 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。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
18,642	44,799.20	144,403,778.59	17.29%	690,742,879.81	82.71%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

截止本报告期末,基金管理人的从业人员未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007 年 1 月 24 日)基金份额总额	4,462,883,026.84
本报告期期初基金份额总额	1,003,167,539.77
本报告期基金总申购份额	38,558,620.43
减:本报告期基金总赎回份额	206,579,501.80
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	835,146,658.40

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2011 年 2 月 18 日,基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第九次会议审议通过,聘任李柯女士为公司副总经理。上该事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告,并经中国证券监督管理委员会审核批准(证监许可[2011]229 号)。

2、2011 年 4 月 23 日,基金管理人发布关于国联安德盛优势股票证券投资基金基金经理变更公告。聘任韦明亮先生担任国联安德盛优势股票证券投资基金的基金经理,本基金原基金经理陈苏桥先生不再担任本基金基金经理的职务。

3、本基金托管人总行资产托管部原总经理夏博辉同志已调离招商银行,根据招商银行招银发[2011]331 号文,夏博辉先生不再担任招商银行总行资产托管部总经理职务,招商银行已聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部负责人。

4、2011 年 7 月 13 日,基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第十八次会议审议通过,许小松先生不再担任公司总经理,由李柯女士担任公司代理总经理。上述变更事项,已按有关规定向中国证券监督管理委员会基金监管部和上海监管局报告,并由中国证券监督管理委员会出具无异议函(基金部函[2011]491 号)。

5、2011 年 10 月 22 日,基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十次会议审议通过,谢荣兴先生不再担任公司督察长,由符学东先生担任公司代理督察长。上述变更事项,已按有关规定向中国证券监督管理委员会基金监管部和上海监管局报告,并由中国证券监督管理委员会出具无异议函(基金部函[2011]809 号)。

6、2011 年 11 月 19 日,基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第十九次会议审议通过,聘任魏东先生为公司副总经理。上述事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告,并经中国证券监督管理委员会审核批准(证监许可[2011]1813 号)。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。本基金报告年度支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 10 万元,目前该事务所已向本基金提供连续 5 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
红塔证券股份有限公司	1	1,305,034,537.29	21.57%	1,109,279.92	22.02%	–
国金证券有限责任公司	1	728,567,281.17	12.04%	591,965.91	11.75%	–
长城证券有限责任公司	1	692,409,192.15	11.45%	562,585.75	11.17%	–
华泰联合证券有限责任公司	1	542,126,343.64	8.96%	440,478.90	8.74%	–
国泰君安证券股份有限公司	1	540,291,425.89	8.93%	459,243.67	9.12%	–
中信证券股份有限公司	1	529,369,154.97	8.75%	430,115.84	8.54%	–
中国银河证券股份有限公司	1	404,947,663.54	6.69%	344,200.87	6.83%	–
中信建投证券有限责任公司	1	357,524,090.08	5.91%	303,895.06	6.03%	–
招商证券股份有限公司	1	303,755,590.49	5.02%	246,802.97	4.90%	–
北京高华证券有限责任公司	1	291,838,345.80	4.82%	248,059.15	4.92%	–
中国国际金融有限公司	1	160,330,946.55	2.65%	136,282.16	2.71%	–
中银国际证券有限责任公司	1	138,285,871.52	2.29%	117,542.24	2.33%	–
广发证券股份有限公司	1	54,854,697.34	0.91%	46,626.55	0.93%	–
中国中投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	原中国建银投资证券有限责任公司
申银万国证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–

注:1、专用交易单元的选择标准和程序

(1)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用,选用标准为:

A 实力雄厚,信誉良好,注册资本不少于 3 亿元人民币。

B 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范,近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格,具备健全的内部控制制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求,并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2)选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后,与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议,通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后,基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况,根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名:

A 提供的研究报告质量和数量;

B 研究报告被基金采纳的情况;

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;

E 由基金管理人提出课题,证券经营机构提供的研究论文质量;

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名,同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留,并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单,基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构,租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求,基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

广发证券股份有限公司的交易单元为本报告期内本基金新租用的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
红塔证券股份有限公司	36,197,892.80	45.01%	–	–	–	–
国金证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
长城证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
华泰联合证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	8,230,449.60	10.23%	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国银河证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信建投证券有限责任公司	35,996,483.90	44.76%	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
北京高华证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	–	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中国中投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
申银万国证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–

国联安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日