国联安货币市场证券投资基金

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：上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一二年三月二十九日

§1 重要提示

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——上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年3月28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26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	国联安货币	
基金主代码	253050	
交易代码	253050	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年1月26日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	117,986,956.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安货币A	国联安货币B
下属分级基金的交易代码	253050	253051
报告期末下属分级基金的份额总额	25,974,034.38份	92,012,921.72份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理，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。
投资策略	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，在此基础之上，确定组合久期和类别资产配置比例，把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择，具体包括以下策略： 1、利率预期策略 2、收益率曲线策略 3、类属配置策略 4、现金流管理策略 5、套利策略 6、个券选择策略
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
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产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于债券型基金，也低于混合型基金与股票型基金。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	周倩芝
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	zhouqz@spdb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95528
传真		021-50151582	021-63602540

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1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	国联安货币A	国联安货币B
本期已实现收益	3,751,873.78	7,095,009.89
本期利润	3,751,873.78	7,095,009.89
本期净值收益率	2.6078%	2.8397%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	
	国联安货币A	国联安货币B
期末基金资产净值	25,974,034.38	92,012,921.72
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3、本基金收益分配按日结转份额。

4、本基金基金合同于2011年1月26日生效，截止至本报告期末本基金成立不满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 国联安货币A：

3.1.1 期间数据和指标	份额净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8344%	0.0061%	0.3756%	0.0000%	0.4588%	0.0061%
过去六个月	1.4898%	0.0049%	0.7511%	0.0000%	0.7387%	0.0049%
过去一年	–	–	–	–	–	–
过去三年	–	–	–	–	–	–
过去五年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	2.6078%	0.0051%	1.3672%	0.0001%	1.2406%	0.0050%

注：本基金基金合同于2011年1月26日生效，截止至本报告期末本基金成立不满一年。

2. 国联安货币B：

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8959%	0.0062%	0.3756%	0.0000%	0.5203%	0.0062%
过去六个月	1.6133%	0.0049%	0.7511%	0.0000%	0.8622%	0.0049%
过去一年	–	–	–	–	–	–
过去三年	–	–	–	–	–	–
过去五年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	2.8397%	0.0051%	1.3672%	0.0001%	1.4725%	0.0050%

注：本基金基金合同于2011年1月26日生效，截止至本报告期末本基金成立不满一年。

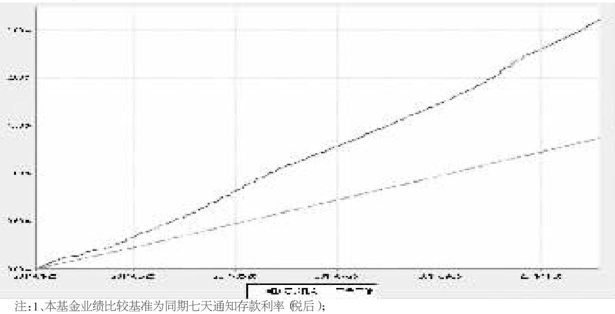
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币市场证券投资基金

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

（2011年1月26日至2011年12月31日）

1、国联安货币A

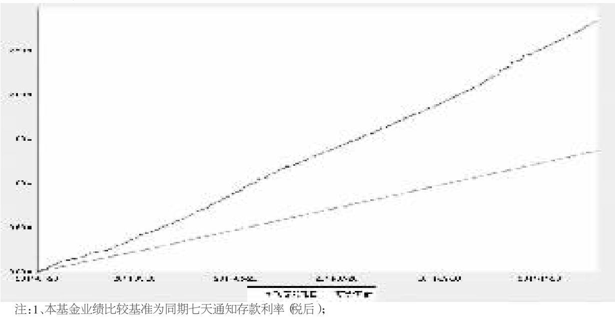


注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于2011年1月26日生效。截止至本报告期末本基金成立不满一年；

3、本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B



注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于2011年1月26日生效。截止至本报告期末本基金成立不满一年；

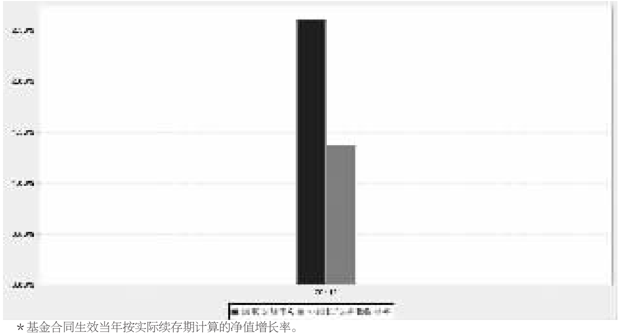
3、本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

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

国联安货币市场证券投资基金

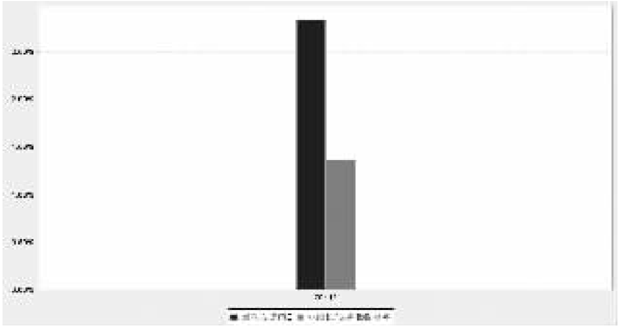
自基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

1、国联安货币A



＊基金合同生效当年按实际续存期计算的净值增长率。

2、国联安货币B



＊基金合同生效当年按实际续存期计算的净值增长率。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

1、国联安货币A

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2011	3,751,873.78	–	–	3,751,873.78	–
合计	3,751,873.78	–	–	3,751,873.78	–

注：2011年度是指自2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

2、国联安货币B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2011	7,095,009.89	–	–	7,095,009.89	–
合计	7,095,009.89	–	–	7,095,009.89	–

注：2011年度是指自2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

§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		
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2011-01-26	–	12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。2008年10月起加入国联安基金管理有限公司，现任债券组合管理部总监，2009年3月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理，2010年6月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理，2011年1月起兼任本基金基金经理。
周志远	本基金基金经理助理、兼任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理助理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、债券研究员	2011-01-27	–	5年（自2007年起）	–

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》、《国联安货币市场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 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。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 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年前3个季度通胀水平持续走高，共计上调准备金率6次，加息3次。紧缩的货币政策导致资金面长期紧张，前三季度银行间7日回购均值达到了4.09%；信贷收紧则直接打击了企业的融资行为，同时各期限信用债券收益率一路走高，短债也未能幸免。2011年第四季度，经济增速和通胀压力同步下降。政策面出现了明显的转向，央行甚至在12月份下调了准备金率，这被市场认为或是宽松货币政策的开始；资金面预期的宽松使得第四季度银行间7日回购利率均值也降到了3.87%，同时也使得债券市场迎来了一波上涨行情，短期利率产品和信用产品收益率开始持续回落。

在2011年前3个季度通胀压力较大的情况下，我们以保持流动性为主，在信用产品方面采取了比较保守的投资风格。第四季度开始，我们配置了一定比例的银行存款，同时配备了一些高收益高信用的短期融资券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安货币A净值收益率为2.6078%，同期业绩比较基准增长率为1.3672%。国联安货币B净值收益率为2.8397%，同期业绩比较基准增长率为1.3672%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2012年外围市场的局面可能更为艰难和复杂。欧债危机可能会进一步扩大，欧元区经济或将陷入轻度衰退。国内或仍将处于经济放缓和通胀下降的情况，央行也许会采取持续的宽松货币政策。在资金成本持续下降的条件下，债券市场各券种收益率可能会继续下行。我们将会在预防信用风险和保持组合流动性的前提下，继续对我们较为看好的投资品种进行合理配置，力争为投资者创造更好的收益。

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，所有成员都具备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

根据本基金基金合同的有关约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付，并只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

本报告期内，本基金已实现收益为10,846,883.67元，实际分配收益10,846,883.67元，其中向本基金A级份额持有人分配利润3,751,873.78元，向本基金B级份额持有人分配利润7,095,009.89元，符合本基金基金合同的约定，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

§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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国联安货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国联安货币市场基金的投资运作进行了监督，对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以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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戴丽、王国蓓对国联安货币市场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.0079）。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：国联安货币市场证券投资基金

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
资产：		
银行存款	7.4.7.1	41,080,354.63
结算备付金		293,181.82
存出保证金		0.00
交易性金融资产	7.4.7.2	50,023,640.30
其中：股票投资		0.00
基金投资		0.00
债券投资	7.4.7.2	50,023,640.30
资产支持证券投资		0.00
衍生金融资产	7.4.7.3	0.00
买入返售金融资产	7.4.7.4	26,000,000.00
应收证券清算款		0.00
应收利息	7.4.7.5	1,029,651.82
应收股利		0.00
应收申购款		21,019.37
递延所得税资产		0.00
其他资产	7.4.7.6	0.00
资产总计		118,447,847.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日
负债：		
短期借款		0.00
交易性金融负债		0.00
衍生金融负债		0.00
卖出回购金融资产款		0.00
应付证券清算款		0.00
应付赎回款		992.56
应付管理人报酬		61,632.39
应付托管费		18,676.50
应付销售服务费		7,678.67
应付交易费用	7.4.7.7	5,904.28
应交税费		0.00
应付利息		0.00
应付利润		0.00
递延所得税负债		0.00
其他负债	7.4.7.8	366,007.44
负债合计		460,891.84
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	117,986,956.10
未分配利润	7.4.7.10	0.00
所有者权益合计		117,986,956.10
负债和所有者权益总计		118,447,847.94

注：1、报告截止日2011年12月31日，基金份额净值1.000元，基金份额总额117,986,956.1份。其中国联安货币A份额为25,974,034.38份；国联安货币B份额为92,012,921.72份。

2、本基金于2011年1月26日成立，截至本报告期末，本基金成立不满一年，无上年度末数据。

3、本摘要中资产负债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：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期 2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入		13,556,183.05
1.利息收入		12,467,448.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,774,297.67
债券利息收入		4,861,287.85
资产支持证券利息收入		–
买入返售金融资产收入		5,831,863.37
其他利息收入		–
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,088,734.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	–
基金投资收益		–
债券投资收益	7.4.7.13	1,088,734.16
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	–
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	–
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	–
减：二、费用		2,709,299.38
1.管理人报酬		1,425,050.90
2.托管费		432,312.79
3.销售服务费		437,579.96
4.交易费用	7.4.7.18	–
5.利息支出		8,634.17
其中：卖出回购金融资产支出		8,634.17
6.其他费用	7.4.7.19	405,721.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,846,883.67
减：所得税费用		–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		–

注：本基金基金合同于2011年1月26日生效，截至本报告期末本基金成立不满一年，因此本报告实际报告期间为2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日；本报告无上年度末数据或上年度可比期间数据（下同）。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月26日（基金合同生效日）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）	2,845,589,169.30	0.00	2,845,589,169.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	10,846,883.67	10,846,883.67
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）	-2,727,602,213.20	0.00	-2,727,602,213.20
其中：1.基金申购款	914,270,871.20	0.00	914,270,871.20
2.基金赎回款	-3,641,873,084.40	0.00	-3,641,873,084.40
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）	0.00	-10,846,883.67	-10,846,883.67
五、期末所有者权益（基金净值）	117,986,956.10	0.00	117,986,956.10

注：本基金于2011年1月26日成立。截至本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。本表中“期初所有者权益（基金净值）”为基金合同生效日即2011年1月26日的数据。

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

国联安货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准国联安货币市场证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2010〕1587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《国联安货币市场证券投资基金基金合同》于2011年1月6日至2011年1月21日募集，基金合同于2011年1月26日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。首次设立募集规模为2,845,589,169.30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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金于2011年1月6日至2011年1月21日募集，募集期间净认购资金人民币2,845,173,610.74元，认购资金在募集期间产生的利息人民币415,558.56元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计2,845,589,169.30份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了KPMG-B（2011）CR No.0002号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》和《国联安货币市场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，包括现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在397天以内（含397天）的债券、剩余期限在397天以内（含397天）的资产支持证券、1年以内（含1年）的银行定期存款、大额存单、期限在1年以内（含1年）的债券回购、期限在1年以内（含1年）的中央银行票据、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

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”）、中国证券业协会于2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》和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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2011年12月31日的财务状况、2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日止的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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的债券投资划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（a）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产-债券投资

买入交易所或银行间的债券均于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入初始确认金额，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。初始确认后，债券投资以实际利率法按摊余成本计量，即债券投资以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑在买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

（b）应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本，终止确认或摊销时收入计入当期损益。

（c）其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

其他金融负债按公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本，终止确认或摊销时支出计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

（a）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产-债券投资

本基金债券投资的估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价对债券投资进行估值。

（b）应收款项及其他金融负债

本基金的应收款项及其他金融负债在初始确认后，采用实际利率法按摊余成本进行估值，直线法与实际利率法确定的余额差异较小的可采用直线法。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值，另外对金融资产的特殊情况处理如下：

（c）影子定价

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，其中，对于偏离程度达到或超过0.5%的情形，基金管理人应与基金托管人协商一致后，参考成交价、市场利率等信息对投资组合进行价值重估，使基金资产净值更能公允地反映基金资产的公允价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

（i）对存在活跃市场的金融工具，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。

（ii）对存在活跃市场的金融工具，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（iii）当金融工具不存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定金融工具的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

（1）本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；

（2）本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

7.4.4.9 费用的确认和计量

根据《国联安货币市场证券投资基金基金合同》的规定，基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率逐日计提。

根据《国联安货币市场证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率逐日计提。

根据《国联安货币市场证券投资基金基金合同》的规定，本基金A级基金份额销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提，B级基金份额销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率逐日计提。若A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过500万份时，该基金账户持有的A类基金份额自动升级为B类基金份额，若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于500万份时，该基金账户持有的B类基金份额自动降级为A类基金份额。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

基金合同生效后的证券交易费用、基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、会计师费、律师费等根据有关法律法规、基金合同及相应协议的规定，由基金托管人按费用实际支出金额支付，列入当期本基金费用。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资者记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。本基金收益每月集中结转一次。基金管理人正式运作基金资产不满一个月的，不结转。每月结转日，若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额；其累计收益为正值，则增加投资者基金份额。若投资者赎回全部基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资者赎回基金款中扣除。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生过会计差错。

7.4.6 税项

（1）主要税项说明

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》、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〔2007〕84号文《财政部国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、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：

（a）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。

（b）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。

（c）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。

（d）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。

（e）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。

（f）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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本报告期内，本基金与关联方无债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	16,081,500,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无支付关联方的佣金。

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26日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,425,050.90
其中：支付销售机构的客户维护费	560,230.42

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.33%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×0.33%/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26日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	432,312.79

注：支付基金托管人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%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×0.1%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安货币A	国联安货币B	合计
浦发银行	391,817.69	14,724.27	406,541.96
国泰君安	243.19	0.00	243.19
国联安基金管理有限公司	1,883.59	11,730.04	13,613.63
合计	393,944.47	26,454.31	420,398.78

注：1、支付基金销售机构的国联安货币A基金份额的销售服务费按前一日国联安货币A基金资产净值0.25%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日国联安货币A基金份额应计提的基金销售服务费=前一日该类基金份额的基金资产净值×0.25%/当年天数。

2、支付基金销售机构的国联安货币B基金份额的销售服务费按前一日国联安货币B基金资产净值0.01%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日国联安货币B基金份额应计提的基金销售服务费=前一日该类基金份额的基金资产净值×0.01%/当年天数。

3、对于由国联安货币B降级为国联安货币A的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级日后的下一个工作日起适用国联安货币A基金份额持有人的费率；对于由国联安货币A升级为国联安货币B的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其升级日后的下一个工作日起享受B级基金份额持有人的费率。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	20,402,364.66	232,493,404.16	–	–	–	–

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，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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，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26日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	11,080,354.63	1,409,467.24

注：本基金通过“浦发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293,181.82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，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，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

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.19.3 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，本基金从事银行间市场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。

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	固定收益投资	50,023,640.30	42.23
	其中：债券	50,023,640.30	42.23
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	26,000,000.00	21.95
	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	41,373,536.45	34.93
4	其他各项资产	1,050,671.19	0.89
	合计	118,447,847.94	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.11	
	其中：买断式回购融资	–	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	–	–
	其中：买断式回购融资	–	–

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	124
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使不符合规定的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	31.68	0.00
–	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天（含）—60天	0.00	0.00
–	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天（含）—90天	59.32	0.00
–	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	16.92	0.00
4	90天（含）—180天	0.00	0.00
–	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天（含）—397天（含）	8.51	0.00
–	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
–	合计	99.51	0.00

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	19,964,673.34	16.92
	其中：政策性金融债	19,964,673.34	16.92
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	30,058,966.96	25.48
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	50,023,640.30	42.40
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,964,673.34	16.92

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	100236	10国开36	200,000	19,964,673.34	16.92
2	041156003	11TCL集CP001	100,000	10,037,712.77	8.51
3	1181071	11北医药CP01	100,000	10,017,812.21	8.49
4	1181090	11大众CP01	100,000	10,003,441.98	8.48

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	3
报告期内偏离度的最高值	0.32%
报告期内偏离度的最低值	-0.20%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.11%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

8.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.8.3 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4 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	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	1,029,651.82
4	应收申购款	21,019.37
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	1,050,671.19

§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

份额级别	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
国联安货币A	735	35,338.82	9,522,741.53	36.66%	16,451,292.85	63.34%
国联安货币B	3	30,670,973.91	91,956,053.58	99.94%	56,868.14	0.06%
合计	738	159,873.92	101,478,795.11	86.01%	16,508,160.99	13.99%

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

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	国联安货币A	1,000.29	0.0039%
	国联安货币B	–	–
	合计	1,000.29	0.0008%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安货币A	国联安货币B
基金合同生效日（2011年1月26日）基金份额总额	1,418,637,246.29	1,426,951,923.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	228,964,652.31	685,306,218.89
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,621,627,864.22	2,020,245,220.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	25,974,034.38	92,012,921.72

注：总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额；总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

§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）。

3、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）。

4、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）。

5、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。本基金本报告期末应支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为6万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续1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	
国泰君安	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

上述交易单元均为在本报告期内新增。

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
国泰君安	–	–	16,081,500,000.00	100.00%	–	–

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

国联安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日