# 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

## 2012 第二季度 报告

[illegible]年6月30日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

§员 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]月[illegible]日止。

§圆 基金产品概况

[illegible]基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国联安上证商品[illegible]联接 |
| 基金主代码 | [illegible] |
| 前端交易代码 | [illegible] |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | [illegible]年[illegible]月[illegible]日 |
| 报告期末基金份额总额 | [illegible]份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为上证大宗商品股票[illegible]的联接基金,主要通过投资于上证大宗商品股票[illegible]以求达到投资目标。当本基金申购赎回和在二级市场买卖上证大宗商品股票[illegible]或本基金自身的申购赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,基金经理会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。 |
| 业绩比较基准 | [illegible]上证大宗商品股票指数收益率+[illegible]银行活期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为上证大宗商品股票[illegible]的联接基金,风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时,本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

[illegible]目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | [illegible] |
| 基金运作方式 | 契约型开放式([illegible]) |
| 基金合同生效日 | [illegible]年[illegible]月[illegible]日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | [illegible]年[illegible]月[illegible]日 |
| 基金管理人名称 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |

注:本表所列的基金主代码[illegible]为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为[illegible]。

[illegible]目标基金产品概况

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。 |
| 投资策略 | 员、股票投资策略<br>本基金股票投资采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:[illegible]法律法规的限制;[illegible]标的指数成份股流动性严重不足;[illegible]标的指数的成份股票长期停牌;[illegible]其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。<br>在正常情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过[illegible],年化跟踪误差不超过[illegible]。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。<br>圆、债券投资策略<br>基于流动性管理的需要,本基金可以投资于国债、央票、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性和提高基金资产的投资收益。<br>猿、股指期货及其他金融衍生品的投资策略<br>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。<br>本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证,充分了解股指期货及其他金融衍生品的特点和各种风险,以审慎的态度参与股指期货及其他金融衍生品。 |
| 业绩比较基准 | 上证大宗商品股票指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、预期收益较高的品种。 |

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿[illegible]主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期([illegible]年[illegible]月[illegible]日[illegible]年[illegible]月[illegible]日) |
|---|---|
| 员.本期已实现收益 | [illegible] |
| 圆.本期利润 | [illegible] |
| 猿.加权平均基金份额本期利润 | [illegible] |
| 源.期末基金资产净值 | [illegible] |
| 缘.期末基金份额净值 | [illegible] |

注:员.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;

圆.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。

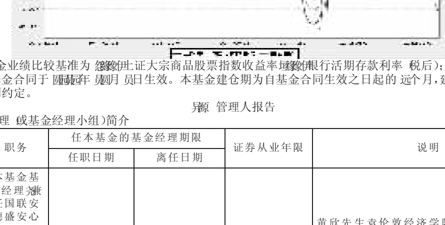
猿[illegible]基金净值表现

猿[illegible]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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

猿[illegible]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
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
([illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日)



注:员.本基金业绩比较基准为[illegible]上证大宗商品股票指数收益率+[illegible]银行活期存款利率(税后);

圆.本基金基金合同于[illegible]年[illegible]月[illegible]日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起[illegible]个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§源 管理人报告

源[illegible]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、兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安双禧中证[illegible]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 | [illegible] | 原 | [illegible]年(自[illegible]年起) | 黄欣先生,伦敦经济学院会计金融专业硕士。[illegible]年[illegible]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。[illegible]年[illegible]月起担任国联安双禧中证[illegible]指数分级证券投资基金基金经理,[illegible]年[illegible]月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,[illegible]年[illegible]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,[illegible]年[illegible]月起兼任本基金基金经理。 |

注:员.基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

圆.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

源[illegible]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。

源[illegible]公平交易专项说明

源[illegible]公平交易制度的执行情况

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实施效果与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等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,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量[illegible]的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

源[illegible]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。

源[illegible]报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源[illegible]报告期内基金投资策略和运作分析

[illegible]年第二季度,在欧债危机影响下,全球避险情绪快速上升,黄金、原油、期铜等大宗商品价格纷纷回落。国内宏观经济总体而言继续呈现下滑的趋势,经济复苏乏力,企业利润增速持续下降;第二季度上证大宗商品指数[illegible]月至[illegible]月出现了一定程度的回落。

本报告期内,上证商品指数成分股中有色金属行业表现相对较好,煤炭、石化等行业表现不甚理想。本报告期内,本基金根据基金合同的约定,保持相当比例的净资产投资于国联安上证商品[illegible],以跟踪上证商品指数,并将跟踪误差控制在合理范围。

源[illegible]报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为[illegible]元,本报告期份额净值增长率为[illegible],同期业绩比较基准收益率为[illegible]。本报告期内,日均跟踪偏离度为[illegible],年化跟踪误差为[illegible],分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过[illegible],以及年化跟踪误差不超过[illegible]的限制。

§缘 投资组合报告

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|
| 员 | 权益投资 | [illegible] | [illegible] |
| | 其中:股票 | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | 基金投资 | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | 固定收益投资 | 原 | 原 |
| | 其中:债券 | 原 | 原 |
| | 资产支持证券 | 原 | 原 |
| 源 | 金融衍生品投资 | 原 | 原 |
| 缘 | 买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| 远 | 银行存款和结算备付金合计 | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | 其他各项资产 | [illegible] | [illegible] |
| 愿 | 合计 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 员 | 上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金 | 股票型 | 契约型开放式([illegible]) | 国联安基金管理有限公司 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|
| 粤 | 农、林、牧、渔业 | [illegible] | [illegible] |
| 月 | 采掘业 | [illegible] | [illegible] |
| 悦 | 制造业 | [illegible] | [illegible] |
| 悦园 | 食品、饮料 | [illegible] | [illegible] |
| 悦员 | 纺织、服装、皮毛 | [illegible] | [illegible] |
| 悦圆 | 木材、家具 | 原 | 原 |
| 悦猿 | 造纸、印刷 | [illegible] | [illegible] |
| 悦源 | 石油、化学、塑胶、塑料 | [illegible] | [illegible] |
| 悦缘 | 电子 | 原 | 原 |
| 悦远 | 金属、非金属 | [illegible] | [illegible] |
| 悦苑 | 机械、设备、仪表 | 原 | 原 |
| 悦愿 | 医药、生物制品 | 原 | 原 |
| 悦怨 | 其他制造业 | 原 | 原 |
| 阅 | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 原 | 原 |
| 耘 | 建筑业 | 原 | 原 |
| 云 | 交通运输、仓储业 | 原 | 原 |
| 郧 | 信息技术业 | 原 | 原 |
| 匀 | 批发和零售贸易 | 原 | 原 |
| 陨 | 金融、保险业 | 原 | 原 |
| 允 | 房地产业 | 原 | 原 |
| 运 | 社会服务业 | 原 | 原 |
| 蕴 | 传播与文化产业 | 原 | 原 |
| 酝 | 综合类 | 原 | 原 |
| | 合计 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 员 | [illegible] | 包钢稀土 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | [illegible] | 紫金矿业 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | [illegible] | 山东黄金 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 源 | [illegible] | 中国石油 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 缘 | [illegible] | 中国神华 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 远 | [illegible] | 中国石化 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | [illegible] | 中金黄金 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 愿 | [illegible] | 江西铜业 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 怨 | [illegible] | 潞安环能 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 员园 | [illegible] | 阳泉煤业 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]投资组合报告附注

缘[illegible]本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除紫金矿业外,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。

紫金矿业([illegible])于[illegible]年[illegible]月[illegible]日发布公告称,于[illegible]年[illegible]月[illegible]日收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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 员 | 存出保证金 | 原 |
| 圆 | 应收证券清算款 | 原 |
| 猿 | 应收股利 | [illegible] |
| 源 | 应收利息 | [illegible] |
| 缘 | 应收申购款 | [illegible] |
| 远 | 其他应收款 | 原 |
| 苑 | 待摊费用 | 原 |
| 愿 | 其他 | 原 |
| 怨 | 合计 | [illegible] |

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

§远 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | [illegible] |
| 报告期期间基金总申购份额 | [illegible] |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | [illegible] |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 原 |
| 报告期期末基金份额总额 | [illegible] |

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。

§苑 备查文件目录

苑[illegible]备查文件目录

员 中国证监会批准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发行及募集的文件
圆 《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合同》
猿 《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招募说明书》
源 《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托管协议》
缘 基金管理人业务资格批件和营业执照
远 基金托管人业务资格批件和营业执照
苑 中国证监会要求的其他文件

苑[illegible]存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路[illegible]号星展银行大厦[illegible]楼

苑[illegible]查阅方式

网址:[illegible]或[illegible]

国联安基金管理有限公司
二〇一二年七月二十日

# 上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金

## 2012 第二季度 报告

[illegible]年6月30日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

§员 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]月[illegible]日止。

§圆 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国联安上证商品[illegible] |
| 基金主代码 | [illegible] |
| 交易代码 | [illegible] |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | [illegible]年[illegible]月[illegible]日 |
| 报告期末基金份额总额 | [illegible]份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。 |
| 投资策略 | 员、股票投资策略<br>本基金股票投资采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数。通常情况下,本基金按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:[illegible]法律法规的限制;[illegible]标的指数成份股流动性严重不足;[illegible]标的指数的成份股票长期停牌;[illegible]其他合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。<br>在正常情况下,本基金对标的指数的跟踪目标是:力争使得基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过[illegible],年化跟踪误差不超过[illegible]。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。<br>圆、债券投资策略<br>基于流动性管理的需要,本基金可以投资于国债、央票、金融债等期限在一年期以下的债券,债券投资的目的是保证基金资产流动性和提高基金资产的投资收益。<br>猿、股指期货及其他金融衍生品的投资策略<br>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。<br>本基金管理人对股指期货及其他金融衍生品的运用将进行充分的论证,充分了解股指期货及其他金融衍生品的特点和各种风险,以审慎的态度参与股指期货及其他金融衍生品。 |
| 业绩比较基准 | 上证大宗商品股票指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票基金,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券基金、混合基金。本基金为指数型基金,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、预期收益较高的品种。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

注:本表所列的基金主代码[illegible]为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为[illegible]。

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿[illegible]主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期([illegible]年[illegible]月[illegible]日[illegible]年[illegible]月[illegible]日) |
|---|---|
| 员.本期已实现收益 | [illegible] |
| 圆.本期利润 | [illegible] |
| 猿.加权平均基金份额本期利润 | [illegible] |
| 源.期末基金资产净值 | [illegible] |
| 缘.期末基金份额净值 | [illegible] |

注:员.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;

圆.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。

猿[illegible]基金净值表现

猿[illegible]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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

猿[illegible]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

上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金
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
([illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日)

注:员.本基金业绩比较基准为上证大宗商品股票指数;

圆.本基金基金合同于[illegible]年[illegible]月[illegible]日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起[illegible]个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§源 管理人报告

源[illegible]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、兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理、国联安双禧中证[illegible]指数分级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 | [illegible] | 原 | [illegible]年(自[illegible]年起) | 黄欣先生,伦敦经济学院会计金融专业硕士。[illegible]年[illegible]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。[illegible]年[illegible]月起担任国联安双禧中证[illegible]指数分级证券投资基金基金经理,[illegible]年[illegible]月起兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,[illegible]年[illegible]月起兼任本基金基金经理,[illegible]年[illegible]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:员.基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

圆.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

源[illegible]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》、《上证大宗商品股票交易型开放式指数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。

源[illegible]公平交易专项说明

源[illegible]公平交易制度的执行情况

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实施效果与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等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,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量[illegible]的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

源[illegible]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。

源[illegible]报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源[illegible]报告期内基金投资策略和运作分析

[illegible]年第二季度,在欧债危机影响下,全球避险情绪快速上升,黄金、原油、期铜等大宗商品价格纷纷回落。国内宏观经济总体而言继续呈现下滑的趋势,经济复苏乏力,企业利润增速持续下降。第二季度上证大宗商品指数[illegible]月至[illegible]月出现了一定程度的回落。

本报告期内,上证商品指数成分股中有色金属行业表现相对较好,煤炭、石化等行业表现不甚理想。本报告期内,本基金根据基金合同的约定,保持在相当比例的仓位,并以完全复制的方法跟踪上证商品指数,将跟踪误差控制在合理范围。

源[illegible]报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为[illegible]元,本报告期份额净值增长率为[illegible],同期业绩比较基准收益率为[illegible]。本报告期内,日均跟踪偏离度为[illegible],年化跟踪误差为[illegible],分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过[illegible],以及年化跟踪误差不超过[illegible]的限制。

§缘 投资组合报告

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|
| 员 | 权益投资 | [illegible] | [illegible] |
| | 其中:股票 | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | 固定收益投资 | 原 | 原 |
| | 其中:债券 | 原 | 原 |
| | 资产支持证券 | 原 | 原 |
| 猿 | 金融衍生品投资 | 原 | 原 |
| 源 | 买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| 缘 | 银行存款和结算备付金合计 | [illegible] | [illegible] |
| 远 | 其他各项资产 | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | 合计 | [illegible] | [illegible] |

注:上述权益投资股票项投资金额包含可退替代款估值增值。

缘[illegible]报告期末按行业分类的股票投资组合

缘[illegible]指数投资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(%) |
|---|---|---|---|
| 粤 | 农、林、牧、渔业 | [illegible] | [illegible] |
| 月 | 采掘业 | [illegible] | [illegible] |
| 悦 | 制造业 | [illegible] | [illegible] |
| 悦园 | 食品、饮料 | [illegible] | [illegible] |
| 悦员 | 纺织、服装、皮毛 | [illegible] | [illegible] |
| 悦圆 | 木材、家具 | 原 | 原 |
| 悦猿 | 造纸、印刷 | [illegible] | [illegible] |
| 悦源 | 石油、化学、塑胶、塑料 | [illegible] | [illegible] |
| 悦缘 | 电子 | 原 | 原 |
| 悦远 | 金属、非金属 | [illegible] | [illegible] |
| 悦苑 | 机械、设备、仪表 | 原 | 原 |
| 悦愿 | 医药、生物制品 | 原 | 原 |
| 悦怨 | 其他制造业 | 原 | 原 |
| 阅 | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 原 | 原 |
| 耘 | 建筑业 | 原 | 原 |
| 云 | 交通运输、仓储业 | 原 | 原 |
| 郧 | 信息技术业 | 原 | 原 |
| 匀 | 批发和零售贸易 | 原 | 原 |
| 陨 | 金融、保险业 | 原 | 原 |
| 允 | 房地产业 | 原 | 原 |
| 运 | 社会服务业 | 原 | 原 |
| 蕴 | 传播与文化产业 | 原 | 原 |
| 酝 | 综合类 | 原 | 原 |
| | 合计 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

缘[illegible]报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

缘[illegible]报告期末指数投资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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 员 | [illegible] | 包钢稀土 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | [illegible] | 紫金矿业 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | [illegible] | 山东黄金 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 源 | [illegible] | 中国石油 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 缘 | [illegible] | 中国神华 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 远 | [illegible] | 中国石化 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | [illegible] | 中金黄金 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 愿 | [illegible] | 江西铜业 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 怨 | [illegible] | 潞安环能 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 员园 | [illegible] | 阳泉煤业 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]投资组合报告附注

缘[illegible]本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除紫金矿业外,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。

紫金矿业([illegible])于[illegible]年[illegible]月[illegible]日发布公告称,于[illegible]年[illegible]月[illegible]日收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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 员 | 存出保证金 | 原 |
| 圆 | 应收证券清算款 | [illegible] |
| 猿 | 应收股利 | [illegible] |
| 源 | 应收利息 | [illegible] |
| 缘 | 应收申购款 | 原 |
| 远 | 其他应收款 | 原 |
| 苑 | 待摊费用 | 原 |
| 愿 | 其他 | 原 |
| 怨 | 合计 | [illegible] |

缘[illegible]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。

缘[illegible]报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

缘[illegible]报告期末指数投资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。

缘[illegible]报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§远 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | [illegible] |
| 报告期期间基金总申购份额 | [illegible] |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | [illegible] |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 原 |
| 报告期期末基金份额总额 | [illegible] |

§苑 备查文件目录

苑[illegible]备查文件目录

员 中国证监会批准上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
圆 《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
猿 《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
源 《上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
缘 基金管理人业务资格批件和营业执照
远 基金托管人业务资格批件和营业执照
苑 中国证监会要求的其他文件

苑[illegible]存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路[illegible]号星展银行大厦[illegible]楼

苑[illegible]查阅方式

网址:[illegible]或[illegible]

国联安基金管理有限公司
二〇一二年七月二十日

# 国联安信心增益债券型证券投资基金

## 2012 第二季度 报告

[illegible]年6月30日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年七月二十日

§员 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]月[illegible]日止。

§圆 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国联安信心增益债券 |
| 基金主代码 | [illegible] |
| 交易代码 | [illegible] |
| 基金运作方式 | 契约型。本基金合同生效后一年内封闭运作,基金合同生效满一年后转为开放运作。 |
| 基金合同生效日 | [illegible]年[illegible]月[illegible]日 |
| 报告期末基金份额总额 | [illegible]份 |
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的前提下,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金在综合考虑基金组合的流动性需求、本金安全和投资风险控制的基础上,根据对宏观经济、货币政策、财政政策以及债券市场和股票市场相对投资价值和风险的分析,在法规及基金合同规定的比例限制内,动态调整现金类资产、债券类资产和权益类资产的比例,追求较低风险下的较高组合收益。<br>本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现组合增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金,属于证券市场中低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |

注:根据基金合同及招募说明书的约定,本基金封闭期自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。自[illegible]年[illegible]月[illegible]日起,本基金运作方式转为开放式,并打开申购、赎回、转换及定期定额投资业务。

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿[illegible]主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期([illegible]年[illegible]月[illegible]日[illegible]年[illegible]月[illegible]日) |
|---|---|
| 员.本期已实现收益 | [illegible] |
| 圆.本期利润 | [illegible] |
| 猿.加权平均基金份额本期利润 | [illegible] |
| 源.期末基金资产净值 | [illegible] |
| 缘.期末基金份额净值 | [illegible] |

注:员.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;

圆.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。

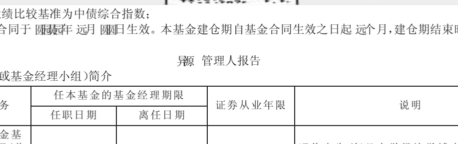
猿[illegible]基金净值表现

猿[illegible]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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去猿个月 | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

猿[illegible]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

国联安信心增益债券型证券投资基金
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
([illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日)



注:员.本基金业绩比较基准为中债综合指数;

圆.本基金基金合同于[illegible]年[illegible]月[illegible]日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起[illegible]个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§源 管理人报告

源[illegible]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 | | |
| 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、国联安货币市场证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监 | [illegible] | 原 | [illegible]年(自[illegible]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。[illegible]年[illegible]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。[illegible]年[illegible]月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,[illegible]年[illegible]月起兼任本基金基金经理,[illegible]年[illegible]月起兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理。 |
| 袁新钊 | 本基金基金经理、兼任国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金经理 | [illegible] | 原 | [illegible]年(自[illegible]年起) | 袁新钊先生,北京大学经济学硕士。[illegible]年[illegible]至[illegible]年[illegible]月在法国巴黎银行(中国)有限公司担任固定收益产品研究员。[illegible]年[illegible]月至[illegible]年[illegible]月在国泰君安证券股份有限公司担任研究员助理、研究员。[illegible]年[illegible]月起加盟国联安基金管理有限公司,曾担任基金经理助理。[illegible]年[illegible]月起担任国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金经理。[illegible]年[illegible]月起兼任本基金基金经理。 |

注:员.基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

圆.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

源[illegible]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》、《国联安信心增益债券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。

源[illegible]公平交易专项说明

源[illegible]公平交易制度的执行情况

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实施效果与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等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,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量[illegible]的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

源[illegible]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。

源[illegible]报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

源[illegible]报告期内基金投资策略和运作分析

第二季度,宏观经济整体而言仍然延续第一季度疲弱的趋势,而从经济增长动力来看,无论是以进出口为代表的外需,还是以固定资产投资为代表的内需起色都不明显,通货膨胀继续回落,企业盈利呈现下滑的趋势。就目前而言,货币政策已经出现了一定程度的放松,银行间资金利率从今年年初以来逐渐下降,但是另一方面,信贷政策并未出现明显的放松迹象,尤其是长期贷款出现大幅增长的可能性较小。在房地产价格和通货膨胀的双重制约下,信贷政策放松的空间较为有限,宏观背景仍然相对支持债券类资产。

在货币供给方面,由于信贷政策出现大幅放松情况的可能性较少,[illegible]以及社会融资增速较难明显回升;另外在人民币升值预期减弱的背景下,从[illegible]年以来各个月度的数据来看,热钱也出现了小幅流出,因此,国内的整体货币供给改善空间不大。

在债券品种方面,基于货币市场利率仍将维持在较低水平,我们认为中等资质信用债或将是较为理想的选择。

源[illegible]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[illegible],同期业绩比较基准收益率为[illegible]。

§缘 投资组合报告

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|
| 员 | 权益投资 | 原 | 原 |
| | 其中:股票 | 原 | 原 |
| 圆 | 固定收益投资 | [illegible] | [illegible] |
| | 其中:债券 | [illegible] | [illegible] |
| | 资产支持证券 | 原 | 原 |
| 猿 | 金融衍生品投资 | 原 | 原 |
| 源 | 买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | 原 | 原 |
| 缘 | 银行存款和结算备付金合计 | [illegible] | [illegible] |
| 远 | 其他各项资产 | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | 合计 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

缘[illegible]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

本基金本报告期末未持有股票。

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|
| 员 | 国家债券 | 原 | 原 |
| 圆 | 央行票据 | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | 金融债券 | [illegible] | [illegible] |
| | 其中:政策性金融债 | [illegible] | [illegible] |
| 源 | 企业债券 | [illegible] | [illegible] |
| 缘 | 企业短期融资券 | [illegible] | [illegible] |
| 远 | 中期票据 | [illegible] | [illegible] |
| 苑 | 可转债 | [illegible] | [illegible] |
| 愿 | 其他 | 原 | 原 |
| 怨 | 合计 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 员 | [illegible] | [illegible]温投债 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | [illegible] | [illegible]嘉建投债 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | [illegible] | [illegible]淮城投 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 源 | [illegible] | [illegible]郡投债 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |
| 缘 | [illegible] | [illegible]石化债 | [illegible] | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]投资组合报告附注

缘[illegible]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。

缘[illegible]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。

缘[illegible]其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 员 | 存出保证金 | [illegible] |
| 圆 | 应收证券清算款 | [illegible] |
| 猿 | 应收股利 | 原 |
| 源 | 应收利息 | [illegible] |
| 缘 | 应收申购款 | [illegible] |
| 远 | 其他应收款 | 原 |
| 苑 | 待摊费用 | 原 |
| 愿 | 其他 | 原 |
| 怨 | 合计 | [illegible] |

缘[illegible]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(%) |
|---|---|---|---|---|
| 员 | [illegible] | 工行转债 | [illegible] | [illegible] |
| 圆 | [illegible] | 石化转债 | [illegible] | [illegible] |
| 猿 | [illegible] | 国电转债 | [illegible] | [illegible] |

缘[illegible]报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§远 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | [illegible] |
| 报告期期间基金总申购份额 | [illegible] |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | [illegible] |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | 原 |
| 报告期期末基金份额总额 | [illegible] |

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。

§苑 备查文件目录

苑[illegible]备查文件目录

员 中国证监会批准国联安信心增益债券型证券投资基金发行及募集的文件
圆 《国联安信心增益债券型证券投资基金基金合同》
猿 《国联安信心增益债券型证券投资基金招募说明书》
源 《国联安信心增益债券型证券投资基金托管协议》
缘 基金管理人业务资格批件和营业执照
远 基金托管人业务资格批件和营业执照
苑 中国证监会要求的其他文件

苑[illegible]存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路[illegible]号星展银行大厦[illegible]楼

苑[illegible]查阅方式

网址:[illegible]或[illegible]

国联安基金管理有限公司
二〇一二年七月二十日