国联安德盛稳健证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§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2013年7月15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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安稳健混合
基金主代码	255010
交易代码	255010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年8月8日
报告期末基金份额总额	156,468,062.27份
投资目标	本基金为平衡型基金,基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验,深入研究中国经济发展的价值驱动因素,采用积极主动的投资策略,运用全程风险管理技术,追求长期稳定的投资收益,为基金持有人提供安全可靠的理财服务。
投资策略	本基金严格遵守科学的投资管理流程,首先采取"自上而下"的分析方法,制定基金资产类别配置和行业配置策略,然后采取"自下而上"的基本面分析,挖掘出管理团队优秀、财务状况良好、增长潜力大、竞争地位独特的上市公司和预期收益率较高的债券。利用全球投资经验和对国内市场的深入了解,在对市场趋势准确判断的前提下,进行积极的战略性和战术性资产配置和调整,构建在既定投资风险下的最优投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中低风险品种,其风险收益特征从长期平均及预期来看,介于单纯的股票型组合与单纯的债券型组合之间,也介于单纯的成长型组合与单纯的价值型组合之间。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	1,860,505.89
2.本期利润	861,665.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055
4.期末基金资产净值	147,451,632.12
5.期末基金份额净值	0.942

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,包含伴随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
过去三个月	0.53%	1.39%	-7.44%	0.94%	7.97%	0.45%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安德盛稳健证券投资基金
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2003年8月8日至2013年6月30日)

注:1.本基金业绩比较基准为沪深300指数×65%+上证国债指数×35%;
2.本基金合同于2003年8月8日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
施卫平	本基金基金经理、兼任国联安德盛精选股票证券投资基金基金经理、国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理	2012-12-1	-	7年(自2006年起)	施卫平先生,南安普顿大学国际金融市场专业硕士,1994年7月至2000年12月在浙江金达期货经纪有限公司担任研究员,2001年1月至2004年3月在浙江中大集团投资都担任投资经理,2006年4月至2009年9月在东方证券股份有限公司担任研究员,2009年9月起加盟国联安基金管理有限公司,曾先后担任高级研究员和基金经理助理,2012年3月起,担任国联安德盛精选股票证券投资基金基金经理,2012年5月起兼任国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理,2012年12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》、《国联安德盛稳健证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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运作分析

2013年第二季度,国内经济增速乏力。固定资产投资同比增速逐月下降;在剔除转港贸易因素后,我国的真实进出口增速出现了大幅回落,5月的进出口贸易增速只有0.4%。拉动经济增长的三驾马车的出口和投资出现熄火,只有消费保持相对稳定。工业品出厂价格降幅持续扩大,通缩的压力在加大。进入6月份,由于诸多因素叠加导致的"钱荒",进一步加剧了市场的下跌态势。市场在经过系统性的下跌后,整体的投资机会开始显现。

在报告期内,本基金采取市值优先和行业分层的抽样方法来复制中小板综合指数。对于日常的申购赎回、新增成份股、流通股本变动、成份股长期停牌等事件,综合考虑交易成本、个股和行业权重偏离等因素进行组合调整,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.5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0.53%,同期业绩比较基准收益率为-7.44%。

§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	101,043,464.86	68.22
	其中:股票	101,043,464.86	68.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,639,565.57	25.41
	其中:债券	37,639,565.57	25.41
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,835,297.65	5.97
7	其他资产	589,447.26	0.40
8	合计	148,107,775.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	78,680,245.89	53.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,591,287.73	4.47
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,120,931.24	10.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	651,000.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	101,043,464.86	68.53

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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	002241	歌尔声学	280,000	10,161,200.00	6.89
2	002236	大华股份	260,000	9,939,800.00	6.74
3	002415	海康威视	240,000	8,481,600.00	5.75
4	600637	百视通	300,000	8,400,000.00	5.70
5	600315	上海家化	139,911	6,294,595.89	4.27
6	600184	光电股份	270,000	6,091,200.00	4.13
7	000848	承德露露	200,000	4,542,000.00	3.08
8	600073	上海梅林	700,000	4,361,000.00	2.96
9	002230	科大讯飞	80,000	3,696,000.00	2.51
10	000049	德赛电池	60,000	3,600,000.00	2.44

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	31,602,700.00	21.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,036,865.57	4.09
8	其他	-	-
9	合计	37,639,565.57	25.53

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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	010303	03国债(3)	130,000	12,755,600.00	8.65
2	010107	21国债(7)	110,000	11,554,400.00	7.84
3	010308	03国债(8)	73,000	7,292,700.00	4.95
4	113003	重工转债	50,000	5,466,000.00	3.71
5	127001	海直转债	5,107	570,865.57	0.39

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	125,458.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	462,215.43
5	应收申购款	1,773.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	589,447.26

5.9.4 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	113003	重工转债	5,466,000.00	3.71
2	127001	海直转债	570,865.57	0.39

5.9.5 报告期末前十名股票中在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在在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	158,200,543.01
报告期期间基金总申购份额	2,064,415.88
减:报告期期间基金总赎回份额	3,796,896.62
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	156,468,062.27

注:总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额;总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安德盛稳健证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安德盛稳健证券投资基金基金合同》
3、《国联安德盛稳健证券投资基金招募说明书》
4、《国联安德盛稳健证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

7.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

7.3 查阅方式

网址:www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

国联安德盛小盘精选证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§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2013年7月15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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安小盘精选混合
基金主代码	257010
交易代码	257010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月12日
报告期末基金份额总额	2,193,415,160.94份
投资目标	本基金是一只积极成长型股票基金,专注投资于中国A股市场上具有成长潜力的小盘股。基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验,在严格的风险控制机制下,采用积极主动的投资策略,通过多角度、多层次的基本面研究,充分发掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会,并通过波段操作的择时策略追求较高的资本利得收益,从而实现投资者资产的长期增值。
投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次是自下而上的证券选择。总体上说,对于本基金的投资重点——小盘股而言,将采取自下而上的方式,综合使用数量化的金融工程模型、科学严谨的财务分析和深入的上市公司调研与独特的草根研究等多种手段精选个股,并在此基础上构建股票投资组合。第二个层次是资产类别配置层面的风险管理,即对基金资产在股票、债券和现金三大资产类别间的配置进行实时监控,并根据当时的宏观经济形势和证券市场行情调整资产配置比例,达到控制基金风险的目的。总之,本基金在投资管理的每一个层次都将定性研究和量化分析有机地结合起来,从而保证投资决策的科学性与风险收益结构的最优性。
业绩比较基准	(天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金是一只积极成长型的股票基金,由于其股票投资组合以小盘股为主,本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	28,505,348.98
2.本期利润	-57,642,445.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0263
4.期末基金资产净值	1,703,298,166.40
5.期末基金份额净值	0.777

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,包含伴随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
过去三个月	-3.12%	1.41%	-4.43%	0.88%	1.31%	0.53%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安德盛小盘精选证券投资基金
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2004年4月12日至2013年6月30日)

注:1.本基金业绩比较基准为(天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%;
2.本基金基金合同于2004年4月12日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹新进	本基金基金经理	2010-3-6	-	9年(自2004年起)	邹新进先生,硕士。邹新进先生于2004年7月加盟中信建投证券有限责任公司(前身为华夏证券有限责任公司)任分析师。2007年7月加入国联安基金管理有限公司,曾先后担任高级研究员、基金经理助理、研究部副总监,2010年3月起担任本基金基金经理,2012年2月至2013年4月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。

注:1.基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;
2.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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运作分析

2013年6月,上证指数下跌13.97%,创业板指数也以下跌12.78%垫底全球主要股市。但同时,创业板指数上半年却上涨41.72%,极致地演绎了冰火两重天的大戏。

去年底股票市场微弱回升后,今年以来持续疲软,主板市场缺乏机会,但流动性较为宽松,市场在预期经济转型中寻找机会,因而以创业板为代表的转型受益股受到资金的追捧,加上羊群效益和赚钱效应的刺激,从而在纠结中抛弃估值较低但前途不明的主板市场,更青睐较高估值却也可能较高成长的创业板市场。

本基金报告期内保持了较高的股票仓位。在行业配置上,本基金主要按照季度初的投资思路重点配置了部分早周期行业以及高成长板块。

4.5 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-3.12%,同期业绩比较基准收益率为-4.43%。

§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	1,205,607,799.47	70.39
	其中:股票	1,205,607,799.47	70.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	349,237,055.80	20.39
	其中:债券	349,237,055.80	20.39
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,000,360.00	5.84
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	18,506,655.21	1.08
7	其他资产	39,377,991.57	2.30
8	合计	1,712,729,862.05	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	57,330,000.00	3.37
C	制造业	904,127,275.59	53.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,932,501.30	1.52
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	28,980,188.00	1.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,043,284.13	1.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	162,194,550.45	9.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,205,607,799.47	70.78

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	000625	长安汽车	13,200,000	122,628,000.00	7.20
2	300088	长信科技	5,800,000	122,322,000.00	7.18
3	600066	宇通客车	5,615,887	102,939,208.71	6.04
4	300171	东富龙	3,880,000	97,620,800.00	5.73
5	002638	勤上光电	6,200,000	85,622,000.00	5.03
6	600376	首开股份	11,019,919	61,160,550.45	3.59
7	000063	中兴通讯	4,700,000	59,925,000.00	3.52
8	600157	永泰能源	9,800,000	57,330,000.00	3.37
9	000002	万 科A	5,800,000	57,130,000.00	3.35
10	002022	科华生物	3,366,075	49,851,570.75	2.93

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	19,980,000.00	1.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,735,000.00	2.92
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	47,817,562.00	2.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	231,704,493.80	13.60
8	其他	-	-
9	合计	349,237,055.80	20.50

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	1,245,590	124,334,793.80	7.30
2	120245	12国开45	500,000	49,735,000.00	2.92
3	113001	中行转债	450,000	45,049,500.00	2.64
4	110020	南山转债	400,000	39,964,000.00	2.35
5	126011	08石化债	387,940	37,746,562.00	2.22

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除勤上光电外,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。

勤上光电(002638)于2013年5月4日发布公告称,于2013年5月3日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌信息披露违法违规予以立案调查的《调查通知书》。

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

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	445,870.60
2	应收证券清算款	35,802,070.58
3	应收股利	-
4	应收利息	3,057,232.23
5	应收申购款	72,818.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,377,991.57

5.9.4 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	124,334,793.80	7.30
2	113001	中行转债	45,049,500.00	2.64
3	110020	南山转债	39,964,000.00	2.35
4	127001	海直转债	22,356,200.00	1.31

5.9.5 报告期末前十名股票中在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在在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,200,922,182.79
报告期期间基金总申购份额	60,794,507.72
减:报告期期间基金总赎回份额	68,301,529.57
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	2,193,415,160.94

注:总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额;总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安德盛小盘精选证券投资基金设立的文件
2、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》
3、《国联安德盛小盘精选证券投资基金招募说明书》
4、《国联安德盛小盘精选证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

7.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

7.3 查阅方式

网址:www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

国联安双力中小板综指分级证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年七月十八日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年7月16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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安双力中小板综指分级(场内简称:国安双力)
基金主代码	162510
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月23日
报告期末基金份额总额	76,942,420.53份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具,从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股,构建目标组合,实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属三级基金的基金简称	国联安双力A中小板综指(场内简称:双力A) / 国联安双力B中小板综指(场内简称:双力B) / 国联安双力中小板综指(场内简称:国安双力)
下属三级基金的交易代码	150069 / 150070 / 162510
报告期末下属三级基金的份额总额	32,929,572.00份 / 32,929,573.00份 / 11,083,275.53份
下属三级基金的风险收益特征	低风险低收益。 / 高风险高收益。 / 本基金为被动投资型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

§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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	3,186,734.91
2.本期利润	253,133.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0024
4.期末基金资产净值	68,998,003.94
5.期末基金份额净值	0.897

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,包含伴随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。

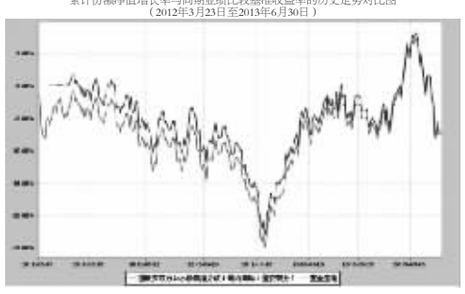
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-3.34%	1.53%	-2.64%	1.55%	-0.70%	-0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安双力中小板综指分级证券投资基金
累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月23日至2013年6月30日)



注:1.本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后);
2.本基金基金合同于2012年3月23日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的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		
黄志钢	本基金基金经理、兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金