国联安中证股债动态策略指数证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十三日

§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10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安股债动态
基金主代码	000060
交易代码	000060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月26日
报告期末基金份额总额	186,947,820.06份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争使基金净值增长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0.5%,年化跟踪误差不超过6%,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	本基金进行被动式指数化投资。其中,除应对赎回所必需的现金类资产之外,其余基金资产严格按照标的指数中股票类资产与债券类资产的比例进行配置。
业绩比较基准	95%×中证股债动态合成期权策略指数收益率+ 5% ×活期存款利率 (税后)
风险收益特征	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。
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

§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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	895,635.62
2.本期利润	2,660,610.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.0122
4.期末基金资产净值	189,309,655.22
5.期末基金份额净值	1.013

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

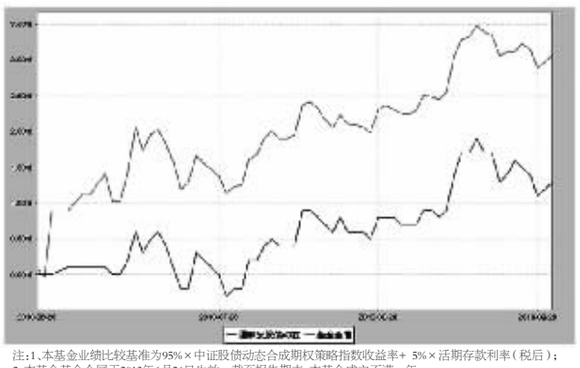
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.20%	0.20%	2.18%	0.20%	-0.98%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年6月26日至2013年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为95%×中证股债动态合成期权策略指数收益率+ 5%×活期存款利率(税后);
2、本基金基金合同于2013年6月26日生效。截至报告期末,本基金成立不满一年;
3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至本报告期末,本基金尚在建仓期。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2013-6-26	-	11年(自2002年起)	黄欣先生,伦敦经济学院会计金融专业硕士,于2003年10月加入国联安基金管理有限公司,历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理。2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理。2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2013年6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》、《国联安证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规、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年第三季度,国内宏观经济各项数据略有好转,流动性相对上个季度有所放松。大盘股在经历二季度的调整后,三季度在金融板块的带领下出现反弹。从沪深300指数的各个板块表现来看,三季度商业、汽车、金融等行业表现较好,食品饮料、煤炭、有色等行业表现较差。

本报告期内,本基金尚处于建仓期,股票仓位较少,主要以完全复制沪深300股票权重的方法进行股票投资;债券部分的投资以逆回购为主。

4.5 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1.013元,本报告期份额净值增长率为1.20%,同期业绩比较基准收益率为2.18%。自2013年8月1日本基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务至本报告期末,日均跟踪偏离度为0.05%,年化跟踪误差为1.05%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.5%,以及年化跟踪误差不超过6%的限制。

§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	26,811,233.73	14.07
	其中:股票	26,811,233.73	14.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	70,000,000.00	36.74
	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	93,632,156.14	49.14
7	其他资产	80,967.72	0.04
8	合计	190,524,357.59	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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(%)
A	农、林、牧、渔业	201,121.15	0.11
B	采矿业	1,892,775.18	1.00
C	制造业	9,632,022.09	5.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	798,488.40	0.42
E	建筑业	951,742.95	0.50
F	批发和零售业	941,930.82	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	608,064.84	0.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	679,682.25	0.36
J	金融业	8,985,937.33	4.75
K	房地产业	1,328,442.90	0.70
L	租赁和商务服务业	206,945.70	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	197,911.76	0.10
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	105,784.07	0.06
S	综合	280,384.29	0.15
	合计	26,811,233.73	14.16

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 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投资股票。

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股票投资明细

5.3.1 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(%)
1	600016	民生银行	118,017	1,128,242.52	0.60
2	600036	招商银行	86,226	941,587.92	0.50
3	601166	兴业银行	59,727	667,150.59	0.35
4	601318	中国平安	17,506	624,964.20	0.33
5	600000	浦发银行	58,477	590,032.93	0.31
6	600837	海通证券	42,280	528,922.80	0.28
7	000002	万 科A	50,578	461,777.14	0.24
8	600030	中信证券	35,984	442,243.36	0.23
9	601328	交通银行	82,032	352,737.60	0.19
10	000651	格力电器	12,572	333,912.32	0.18

5.3.2 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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除中国平安外,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。

中国平安(601318)于2013年5月22日发布公告称,其控股子公司平安证券有限责任公司于近日收到中国证券监督管理委员会的《行政处罚和市场禁入事先告知书》。

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,不存在拟害基金份额持有人利益的行为。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,077.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	3,049.06
4	应收利息	66,849.63
5	应收申购款	991.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	80,967.72

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末按券的股票存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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未存在流通受限的情况。

5.10.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	232,026,266.44
报告期期间基金总申购份额	298,824.13
减:报告期期间基金总赎回份额	45,377,270.51
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	186,947,820.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安中证股债动态策略指数证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金合同》
3、《国联安中证股债动态策略指数证券投资基金招募说明书》
4、《国联安中证股债动态策略指数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

8.2 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

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

国联安德盛精选股票证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安精选股票
基金主代码	257020
前端交易代码	257020
后端交易代码	257021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月28日
报告期末基金份额总额	3,364,470,984.06份
投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司来获得长期稳定的收益。
投资策略	本基金是股票型基金,在股票投资上主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时,适度把握宏观经济情况进行资产配置。具体来说,本基金通过以下步骤进行股票选择:首先,通过ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力,通过WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本;其次,将公司的获利能力和资本成本指标相结合,选择出创造价值的公司;最后,根据公司的成长能力和估值指标,选择股票,构建股票组合。
业绩比较基准	沪深300指数×85%+上证国债指数×15%
风险收益特征	中高风险,较高的预期收益。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	90,149,671.38
2.本期利润	379,009,021.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0976
4.期末基金资产净值	3,213,950,679.29
5.期末基金份额净值	0.955

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

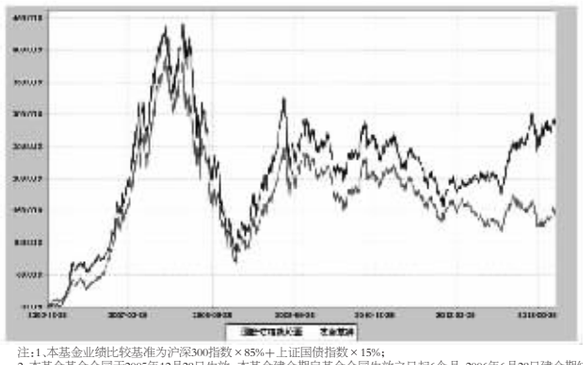
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.79%	1.37%	8.15%	1.22%	2.64%	0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国联安德盛精选股票证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年12月28日至2013年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为沪深300指数×85%+上证国债指数×15%;
2、本基金基金合同于2005年12月28日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,2006年6月28日建仓期结束当日除股票投资比例略高于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定;
3、本基金于2006年6月17日已基本建仓完毕,各项资产配置比例自该日起符合基金合同的约定。由于2006年6月28日有大额赎回从而导致股票投资比例当日被动超标,本基金已于2006年6月29日及时调整完毕。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏东	本基金基金经理、兼任副总经理和投资总监	2009-9-30	-	16年(自1997年起)	魏东先生,复旦大学经济学硕士,曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司;2003年1月加盟华宝兴业基金管理公司,先后担任交易部总经理、宝康灵活配置基金和先进成长基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月加入国联安基金管理有限公司,先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009年9月起担任本基金基金经理。2009年12月至2011年8月,兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金基金经理。2011年11月起,担任公司副总经理。
施卫平	本基金基金经理、兼任国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理、国联安德盛稳健证券投资基金基金经理	2012-3-31	-	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部担任投资经理。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,担任本基金基金经理。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月起兼任国联安德盛稳健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》、《国联安德盛精选股票证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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年第三季度,本基金始终看好市场,并保持了较高的股票仓位,但由于整体板块配置较为保守,虽在消费类个股配置上获得了较好的收益,但成长股的配置较少整体业绩表现不突出。

本基金认为宏观经济仍然将保持相对平稳,四季度出现大幅下滑的可能性不大,同时预期流动性虽略有紧张,也将保持相对平稳,因此市场仍或将维持震荡的格局。影响市场的可能因素包括,一是创业板估值水平已经相对较高,未来持续时间较难判断,二是IPO出来后市场格局会不会有所改变。出于谨慎的角度考虑,我们继续看好低估值个股,力求获取稳定收益。

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10.79%,同期业绩比较基准收益率为8.15%。

§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	2,898,882,708.95	89.90
	其中:股票	2,898,882,708.95	89.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	231,409,963.72	7.18
7	其他资产	94,211,671.94	2.92
8	合计	3,224,504,344.61	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	86,649,000.00	2.70
C	制造业	1,756,537,308.95	54.65
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	158,040,000.00	4.92
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	293,600,400.00	9.14
J	金融业	270,464,000.00	8.42
K	房地产业	176,992,000.00	5.51
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	156,600,000.00	4.87
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	2,898,882,708.95	90.20

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	600887	伊利股份	4,700,000	209,996,000.00	6.53
2	000423	东阿阿胶	5,120,000	206,899,200.00	6.44
3	000963	华东医药	3,600,000	158,040,000.00	4.92
4	000069	华侨城A	27,000,000	156,600,000.00	4.87
5	002230	科大讯飞	3,120,000	148,574,400.00	4.62
6	600406	国电南瑞	9,900,000	143,055,000.00	4.45
7	600276	恒瑞医药	3,300,000	120,021,000.00	3.73
8	600048	保利地产	12,000,000	118,560,000.00	3.69
9	002376	新北洋	9,600,000	116,928,000.00	3.64
10	002028	思源电气	7,450,000	115,102,500.00	3.58

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,016,463.10
2	应收证券清算款	91,070,169.25
3	应收股利	-
4	应收利息	58,994.24
5	应收申购款	66,045.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,211,671.94

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,245,655,046.07
报告期期间基金总申购份额	251,554,940.19
减:报告期期间基金总赎回份额	1,132,739,002.20
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,364,470,984.06

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 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内无管理人运用固有资金申购、赎回或者买卖本公司管理的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

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

8.2 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

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

国联安信心增益债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:二〇一三年十月二十三日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月21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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安信心增益债券
基金主代码	253030
交易代码	253030
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	2010年6月22日
报告期末基金份额总额	859,941,152.28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。 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2010年6月22日起至2011年6月21日止。自2011年6月22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。

§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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	12,914,765.20
2.本期利润	3,165,541.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0031
4.期末基金资产净值	873,131,262.00
5.期末基金份额净值	1.015

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

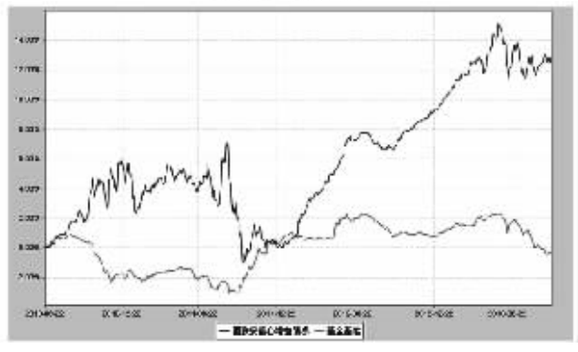
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.24%	-1.92%	0.07%	2.42%	0.17%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国联安信心增益债券型证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年6月22日至2013年9月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为中债综合指数;
2、本基金基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、国联安保本混合型证券投资基金基金经理	2012-6-19	-	6年(自2007年起)	袁新钊先生,北京大学经济学硕士。2007年7至2009年6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。2009年6月至2011年4月在国泰君安证券股份有限公司担任研究员助理、研究员。2011年4月起加盟国联安基金管理有限公司,曾担任基金经理助理,2012年3月起担任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。2012年6月起兼任本基金基金经理。2013年4月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。
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、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2010-6-22	2013-7-13	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