国联安双力中小板综指分级证券投资基金

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	51,710,603.01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	21,276,189份	21,276,190份	9,158,224.01份
下属三级基金的风险收益特征	双力A:低风险低收益。	双力B:高风险高收益。	国安双力: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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,159,599.19
2.本期利润	11,238,818.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.1700
4.期末基金资产净值	54,862,480.20
5.期末基金份额净值	1.061

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。

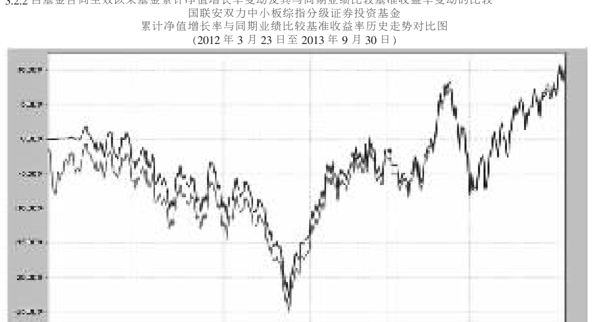
3.2 基金净值表现

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	18.28%	1.39%	19.52%	1.39%	-1.24%	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

国联安双力中小板综指分级证券投资基金
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
(2012年3月23日至2013年9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,兼任国联安中证医药100指数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助理、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助理	2012-3-23	-	6年(自2007年起)	黄志钢先生,硕士,先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司,曾担任金融工程分析师。2010年11月起担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助理,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助理,2012年3月起兼任本基金基金经理,2012年6月至2013年7月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起兼任国联安中证医药100指数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》、《国联安双力中小板综指分级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,国内经济出现逐步好转迹象,8月份的工业增加值同比增长10.4%,远好于预期。8月份固定资产投资维持平稳向上趋势;社会消费品零售总额同比增速和进出口同比增速保持稳定;居民消费价格指数温和可控;工业品出厂价格指数稳步回升。

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

截止报告期末,本基金份额净值为1.061元,本报告期份额净值增长率为18.28%,同期业绩比较基准收益率为19.52%。本报告期内,日均跟踪偏离度为0.05%,年化跟踪误差为1.02%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,以及年化跟踪误差不超过4.0%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	52,420,053.47	92.97
	其中:股票	52,420,053.47	92.97
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	3,931,651.46	6.97
7	其他资产	29,231.79	0.05
8	合计	56,380,936.72	100.00

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 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	928,560.08	1.69
B	采矿业	699,721.89	1.28
C	制造业	37,943,775.12	69.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	420,798.05	0.77
E	建筑业	2,484,546.04	4.53
F	批发和零售业	3,391,262.99	6.18
G	交通运输、仓储和邮政业	337,062.74	0.61
H	住宿和餐饮业	230,173.26	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,755,550.55	5.02
J	金融业	857,534.20	1.56
K	房地产业	1,299,306.15	2.37
L	租赁和商务服务业	974,081.71	1.78
M	科学研究和技术服务业	97,680.69	0.18
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	52,420,053.47	95.55

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	002415	海康威视	64,425	1,700,820.00	3.10
2	002024	苏宁云商	111,063	1,427,159.55	2.60
3	002241	歌尔声学	26,753	1,131,116.84	2.06
4	002304	洋河股份	14,719	638,951.79	1.16
5	002236	大华股份	13,683	623,671.14	1.14
6	002081	金螳螂	24,671	540,788.32	0.99
7	002142	宁波银行	59,660	528,587.60	0.96
8	002065	东华软件	15,910	522,802.60	0.95
9	002353	杰瑞股份	7,071	495,535.68	0.90
10	002344	海宁皮城	22,759	493,870.30	0.90

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	28,348.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	883.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,231.79

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

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002065	东华软件	522,802.60	0.95	重大事项停牌

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

本基金本报告期末前五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

项目	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)
报告期期初基金份额总额	32,929,572.00	32,929,573.00	11,083,275.53
报告期期间基金总申购份额	-	-	665,074.34
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	25,896,891.86
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-11,653,383.00	-11,653,383.00	23,306,766.00
报告期期末基金份额总额	21,276,189.00	21,276,190.00	9,158,224.01

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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,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双力中小板综指分级证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》

3、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》

4、《国联安双力中小板综指分级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

国联安信心增长定期开放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	国联安定期开放债券	
基金主代码	253060	
基金运作方式	契约型开放式(本基金自《基金合同》生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次)	
基金合同生效日	2012年2月22日	
报告期末基金份额总额	1,952,207,668.62份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动地投资管理,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略,在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上,主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种,构建及调整固定收益投资组合,以期获得最大化的债券收益;并通过适当参与新股发行申购及增发新股申购等较低风险投资品种,力争获取超额收益。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,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	
下属两级基金的基金简称	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
下属两级基金的交易代码	253060	253061
报告期末下属两级基金的份额总额	1,498,995,613.14份	453,212,055.48份

注:本基金以定期开放方式运作,其封闭期为自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的第一个封闭期为自《基金合同》生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入为期5个工作日的首个开放期,如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起,继续计算该开放期时间,直至满足《基金合同》关于开放期的时间要求,即每次打开申购与赎回业务办理时间达到5个工作日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年,以此类推。

§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)	
	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
1.本期已实现收益	8,087,772.03	2,065,622.73
2.本期利润	-8,816,504.95	-3,022,371.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0059	-0.0067
4.期末基金资产净值	1,611,207,936.22	484,927,606.41
5.期末基金份额净值	1.075	1.070

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

1、国联安定期开放债券A:

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	-0.56%	0.17%	0.76%	0.01%	-1.32%	0.16%

2、国联安定期开放债券B:

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	-0.65%	0.17%	0.76%	0.01%	-1.41%	0.16%

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

国联安信心增长定期开放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的历史走势对比图
(2012年2月22日至2013年9月30日)

1. 国联安定期开放债券A

注:1、本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率;

2、本基金基金合同于2012年2月22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。

2. 国联安定期开放债券B

注:1、本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率;

2、本基金基金合同于2012年2月22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		
袁新钊	本基金基金经理、兼任国联安信心增益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	2012-3-31	-	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月起担任本基金基金经理。2012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。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。

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》、《国联安信心增长定期开放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。

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

经济增长在2013年7月份开始出现了小幅改善的情况,房地产、基建投资带动整体固定资产投资回升,工业增加值增速也小幅回升;外需方面,对东南亚国家出口增速较快,但对欧美日出口改善程度并不明显。可见,总需求在2013年第三季度出现一定程度的上升,但持续性仍然比较脆弱,一方面,房地产投资紧跟房地产销售的变化,但房地产销售增速在今年一季度达到高点之后持续回落,并且商品房价格在9月份有加速上涨的迹象,房地产投资增速可能出现回落。出口增速有可能在欧美日经济改善的带动下逐渐恢复,但目前来看,发达经济体经济恢复力度仍然较弱。

本基金认为通货膨胀在四季度压力不大,但需要关注房价上涨风险,房价过快上涨可能带来通胀预期上升,或者引发货币政策收紧。

资金面在四季度可能有季节性改善,年底的财政存款投放也会增加货币供给,而在整体经济相对平稳的前提下,央行货币政策一般不会出现太大的改变,因此,债券收益率在四季度可能维持平稳,信用债收益率在经历了三季度的调整之后,已经达到较高水平,具备一定的配置价值,本基金组合配置会适当增加信用债配置,同时关注信用风险的变化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,国联安定期开放债券A的份额净值增长率为-0.56%,同期业绩比较基准收益率为0.76%;国联安定期开放债券B的份额净值增长率为-0.65%,同期业绩比较基准收益率为0.76%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,277,371,722.62	94.30
	其中:债券	3,277,371,722.62	94.30
	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	49,862,485.22	1.43
7	其他资产	148,241,429.00	4.27
8	合计	3,475,475,636.84	100.00

5.2 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	62,057,952.00	2.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	2,579,979,014.62	123.08
5	企业短期融资券	119,720,000.00	5.71
6	中期票据	296,874,000.00	14.16
7	可转债	218,740,756.00	10.44
8	其他	-	-
9	合计	3,277,371,722.62	156.35

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	113003	重工转债	910,000	115,697,400.00	5.52
2	110016	川投转债	813,800	103,043,356.00	4.92
3	122607	12渝地产	800,000	83,664,000.00	3.99
4	122972	09绵投控	800,000	81,952,000.00	3.91
5	010107	21国债(7)	601,920	62,057,952.00	2.96

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	637,011.80
2	应收证券清算款	68,996,497.05
3	应收股利	-
4	应收利息	78,607,920.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,241,429.00

5.10.4 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	115,697,400.00	5.52
2	110016	川投转债	103,043,356.00	4.92

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
报告期期初基金份额总额	1,498,995,613.14	453,212,055.48
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	1,498,995,613.14	453,212,055.48

§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信心增长定期开放债券型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》

3、《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安信心增长定期开放债券型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

国联安优选行业股票型证券投资基金

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:中国银行股份有限公司
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	国联安优选行业股票
基金主代码	257070
交易代码	257070
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月23日
报告期末基金份额总额	843,856,054.93份
投资目标	本基金主要投资于流动性周期、企业盈利周期和通货膨胀周期中的景气行业,优选景气行业中具有高成长性的企业,在控制风险的前提下,努力实现超越业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	在股票投资方面,本基金通过自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,前瞻性地把握中国经济成长和结构转型过程中行业景气度的变化,以定量分析和定性分析相结合的方法,动态优选不同经济周期阶段的景气行业;并结合价值投资理念,挖掘该行业的成长性个股,获取超额收益率;在债券投资方面,本基金采用久期控制下的债券积极投资策略,满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益;本基金将在严格控制风险的前提下,进行权证的投资。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	较高预期风险、较高预期收益
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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	22,900,032.13
2.本期利润	180,110,707.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.2361
4.期末基金资产净值	1,184,492,748.46
5.期末基金份额净值	1.404

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。

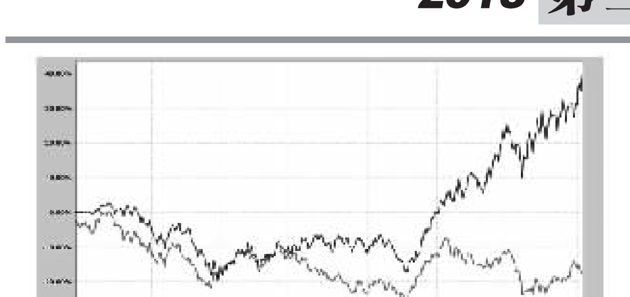
3.2 基金净值表现

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	21.14%	1.65%	7.70%	1.15%	13.44%	0.50%

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

国联安优选行业股票型证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年5月23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×80%+上证国债指数×20%;

2、本基金基金合同于2011年5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		
王忠波	本基金基金经理、兼任总经理助理和研究总监	2011-5-23	-	17年(自1996年起)	王忠波先生,博士研究生学历,高级会计师,曾先后在山东证券公司、深圳证券交易所从事研究工作,2002年6月加入银河基金管理有限公司,历任研究部宏观策略与行业研究员、副总监、总监等职务。2008年4月至2009年8月担任银河稳健证券投资基金的基金经理,2009年4月至2010年10月担任银河行业优选股票型证券投资基金的基金经理。2010年12月起加入国联安基金管理有限公司,现担任本基金基金经理、兼任总经理助理和研究总监。

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》、《国联安优选行业股票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。

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

在经历了六月份的快速下跌后,2013年第三季度市场呈现缓慢上行态势,七月份市场对于政府在调结构与稳增长之间的观点猜测使得股票市场围绕周期与成长轮番较大幅波动,随后预期稳定加上宏观数据的好转,结构性行情继续演化。

在三季度本基金看好股票市场的结构性机会,紧密跟踪各成长性的景气变化,力求精选优质公司。

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21.14%,同期业绩比较基准收益率为7.70%。

§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	1,042,868,102.57	86.79
	其中:股票	1,042,868,102.57	86.79
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	108,582,249.07	9.04
7	其他资产	50,145,980.76	4.17
8	合计	1,201,596,332.40	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	4,662,000.00	0.39
C	制造业	760,867,738.76	64.24
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	38,176,153.19	3.22
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	167,811,832.88	14.17
J	金融业	2,458,000.00	0.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,045,914.00	1.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,920,161.25	1.68
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	30,926,302.49	2.61
S	综合	-	-
	合计	1,042,868,102.57	88.04

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	601633	长城汽车	1,199,362	61,263,410.96	5.17
2	600587	新华医疗	999,021	60,520,692.18	5.11
3	002415	海康威视	2,098,489	55,400,109.60	4.68
4	600887	伊利股份	999,945	44,677,542.60	3.77
5	002065	东华软件	1,313,763	43,170,252.18	3.64
6	002241	歌尔声学	919,229	38,865,002.12	3.28
7	600637	百视通	699,000	36,592,650.00	3.09
8	600332	白云山	999,692	35,569,041.36	3.00
9	603000	人民网	359,933	33,797,708.70	2.85
10	300298	三诺生物	529,802	32,021,232.88	2.70

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	490,692.26
2	应收证券清算款	9,703,895.69
3	应收股利	-
4	应收利息	18,034.42
5	应收申购款	39,933,358.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,145,980.76

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002065	东华软件	43,170,252.18	3.64	重大事项未公告

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	663,506,905.34
报告期期间基金总申购份额	418,331,486.08
减:报告期期间基金总赎回份额	237,982,336.49
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	843,856,054.93

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优选行业股票型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安优选行业股票型证券投资基金基金合同》

3、《国联安优选行业股票型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安优选行业股票型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