国联安货币市场证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:二〇一四年三月三十一日

§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2014年3月27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2013年1月1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	4,189,865,371.33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	297,789,652.96份	3,892,075,718.37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	廖原
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	liaoy03@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	http://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	2013年		2012年		2011年1月26日至2011年12月31日	
	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B
本期已实现收益	2,508,461.91	27,844,873.88	2,855,935.08	7,661,323.83	3,751,873.78	7,095,009.89
本期利润	2,508,461.91	27,844,873.88	2,855,935.08	7,661,323.83	3,751,873.78	7,095,009.89
本期基金份额净值收益率	3.7406%	3.9888%	3.7742%	4.0235%	2.6078%	2.8397%
3.1.2期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B	国联安货币A	国联安货币B
期末基金资产净值	297,789,652.96	3,892,075,718.37	46,046,884.00	364,930,972.77	25,974,034.38	92,012,921.72
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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三年。

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:

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	1.1932%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.8529%	0.0020%
过去六个月	2.1152%	0.0027%	0.6805%	0.0000%	1.4347%	0.0027%
过去一年	3.7406%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	2.3906%	0.0028%
过去三年	–	–	–	–	–	–
过去五年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	10.4635%	0.0055%	4.1350%	0.0002%	6.3285%	0.0053%

注:1、本基金收益分配按日结转份额;

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.2535%	0.0020%	0.3403%	0.0000%	0.9132%	0.0020%
过去六个月	2.2375%	0.0027%	0.6805%	0.0000%	1.5570%	0.0027%
过去一年	3.9888%	0.0028%	1.3500%	0.0000%	2.6388%	0.0028%
过去三年	–	–	–	–	–	–
过去五年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	11.2445%	0.0055%	4.1350%	0.0002%	7.1095%	0.0053%

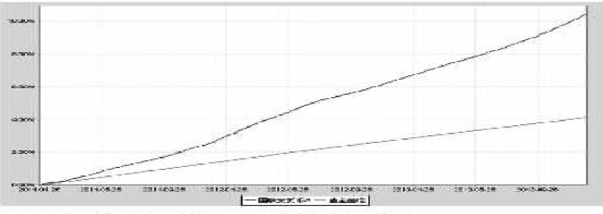
注:1、本基金收益分配按日结转份额;

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
份额累计净值收益率及同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年1月26日至2013年12月31日)

1、国联安货币A

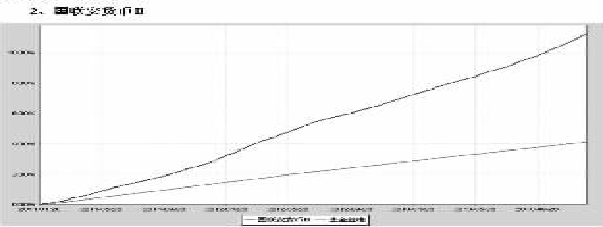


注:1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2011年1月26日生效。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;

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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);

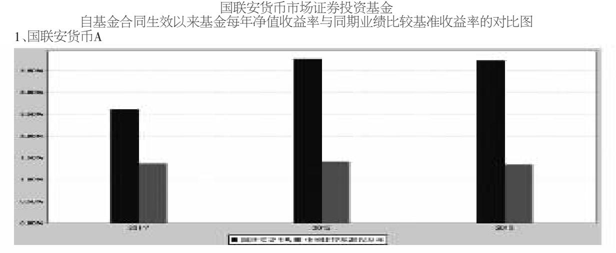
2、本基金基金合同于2011 年1月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

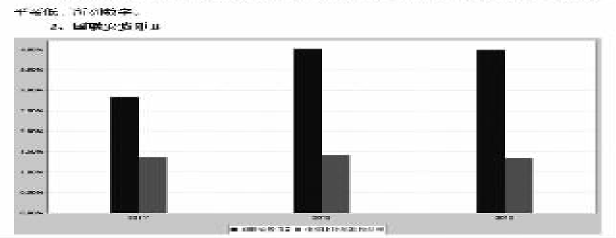
1、国联安货币A



注:*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率。

所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、国联安货币B



注:1、*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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
2013	2,508,461.91	–	–	2,508,461.91	–
2012	2,855,935.08	–	–	2,855,935.08	–
2011	3,751,873.78	–	–	3,751,873.78	–
合计	9,116,270.77	–	–	9,116,270.77	–

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

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
2013	27,844,873.88	–	–	27,844,873.88	–
2012	7,661,323.83	–	–	7,661,323.83	–
2011	7,095,009.89	–	–	7,095,009.89	–
合计	42,601,207.60	–	–	42,601,207.60	–

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二十一只开放式基金。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		
薛琳	本基金基金经理、兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理助理	2012-07-11	–	8年(自2006年起)	薛琳女士,管理学学士。先后在上海红顶金融研究中心公司担任项目管理工作,上海国利货币有限公司担任债券交易员,上海长江养老保险股份有限公司担任债券交易员。2010年6月起加入国联安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理职务。2012年7月起担任本基金基金经理,2012年12月起兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理,2013年6月起兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理助理。

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公平交易制度和控制方法

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。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度,分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分, 投资组合经理在授权范围内自主决策, 超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台,不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度, 通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度,投资交易指令统一通过交易室下达,严格遵守公平交易原则,启用交易系统中的公平交易模块,按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令;对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量,交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配;对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易,以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认,确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应,并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部定期对成交的银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

4.3.2公平交易制度的执行情况

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。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制, 对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析,未发现异常交易。

本报告期内, 本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超过该证券当日成交量5%的交易次数为1次,是由于指数型基金以跟踪标的指数为投资目标,需要根据基金的申购或赎回情况对标的指数成分股进行买入或卖出操作。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,执行了95%置信区间、假设溢价率为0的T分布检验,同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析,未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

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

2013年下半年开始,总体来说资金市场适度紧张的态势可能是央行最愿意看到的结果。具体到债券市场来说,2013年全年下来,债券市场的潜在政策性风险的点基本明朗,尤其是季度末关于地方债务审计报告的出台基本把市场悬疑、担心的“最后一块石头”揭开,2014年一季度政策风险一般不会成为市场关注的焦点,但是经济的不确定性和持续高企的利率可能加速信用风险的出现,信用债的分化可能更加明显,对比信用债,一季度利率债的收益率有较大机会在历史高位出现稳定,而可能出现的9号文的出台将可能是一个重要的促稳因素。

2013年我们首先保证了基金的流动性和安全性,然后抓住资金高企的机会增配了存款,提高了基金收益。

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3.7406%,同期业绩比较基准增长率为1.3500%。国联安货币B净值收益率为3.9888%,同期业绩比较基准增长率为1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年一季度货币政策可能依然不会有大的变化,央行在公开市场操作的手段可能会更加灵活,资金收和放的时点变动可能在节假日前更加频繁。债市未来一段时间还是一个调整的过程,整个操作上面临的还是一个防御性的问题,组合保持较短久期并看重利率债和高评级信用债的投资价值,力争能够带来较为理想的投资回报。

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

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定,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。

本基金对本报告期内利润分配情况如下,符合本基金基金合同的相关规定。

本基金向本基金A级份额持有人共分配利润2,508,461.91元, 向本基金B级份额持有人共分配利润27,844,873.88元。

§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对国联安基金管理有限公司国联安货币市场证券投资基金证券投资基金2013年12月31日的资产负债表,2013年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第1400225号)。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	1,964,934,528.67	268,760,984.45
结算备付金		1,285,714.29	118,181.82
存出保证金		–	–
交易性金融资产	7.4.7.2	239,716,805.26	99,655,700.17
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资	7.4.7.2	239,716,805.26	99,655,700.17
资产支持证券投资		–	–
衍生金融资产	7.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,595,116,894.18	79,000,000.00
应收证券清算款		20,016,446.81	–
应收利息	7.4.7.5	11,086,552.12	2,064,674.51
应收股利		–	–
应收申购款		358,725,615.27	4,896,122.56
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	–	–
资产总计		4,190,882,556.60	454,495,663.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债	7.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		–	–
应付证券清算款		–	42,979,941.67
应付赎回款		4,274.36	64,783.89
应付管理人报酬		570,236.10	96,848.77
应付托管费		172,798.82	29,348.14
应付销售服务费		47,291.04	11,414.26
应付交易费用	7.4.7.7	8,559.31	6,072.33
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	7.4.7.8	214,025.64	329,397.68
负债合计		1,017,185.27	43,517,806.74
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	4,189,865,371.33	410,977,856.77
未分配利润	7.4.7.10	–	–
所有者权益合计		4,189,865,371.33	410,977,856.77
负债和所有者权益总计		4,190,882,556.60	454,495,663.51

注:1、报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额4,189,865,371.33份。其中国联安货币A份额为297,789,652.96份;国联安货币B份额为3,892,075,718.37份。

2、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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		33,841,492.95	12,574,094.86
1.利息收入		33,132,616.43	11,293,793.95
其中:存款利息收入	7.4.7.11	23,302,810.13	7,639,731.92
债券利息收入		5,350,910.70	3,170,381.29
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		4,478,895.60	483,680.74
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		708,876.52	1,280,300.91
其中:股票投资收益	7.4.7.12	0.00	0.00
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.4.7.13	708,876.52	1,280,300.91
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		3,488,157.16	2,056,835.95
1.管理人报酬		2,244,364.53	991,138.41
2.托管费		680,110.54	300,344.94
3.销售服务费		219,329.84	220,873.33
4.交易费用	7.4.7.18	–	–
5.利息支出		62,361.71	151,597.50
其中:卖出回购金融资产支出		62,361.71	151,597.50
6.其他费用	7.4.7.19	281,990.54	392,881.77
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		30,353,335.79	10,517,258.91
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		30,353,335.79	10,517,258.91

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	410,977,856.77	–	410,977,856.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	30,353,335.79	30,353,335.79
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)	3,778,887,514.56	–	3,778,887,514.56
其中:1.基金申购款	6,471,297,316.21	–	6,471,297,316.21
2.基金赎回款	-2,692,409,801.65	–	-2,692,409,801.65
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)	–	-30,353,335.79	-30,353,335.79
五、期末所有者权益(基金净值)	4,189,865,371.33	–	4,189,865,371.33
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	117,986,956.10	–	117,986,956.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	10,517,258.91	10,517,258.91
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)	292,990,900.67	–	292,990,900.67
其中:1.基金申购款	1,690,117,416.97	–	1,690,117,416.97
2.基金赎回款	-1,397,126,516.30	–	-1,397,126,516.30
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)	–	-10,517,258.91	-10,517,258.91
五、期末所有者权益(基金净值)	410,977,856.77	–	410,977,856.77

注:报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从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》发售,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。

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

本基金的财务报表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”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

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2013年12月31日的财务状况、2013年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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[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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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
国联安-中都-股指期货趋势分级1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-泓湖CTA资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-民生-灵活配置分级11号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-辉石-债券分级1号特定多客户资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-民生-灵活配置分级10号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-丰利财富-对冲策略3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-中证恒远对冲1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-朱雀-阿尔法8号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-泓湖重域-宏观对冲1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-弘尚资产成长精选1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-佰睿吉3号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-无花果分级1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-佰睿吉6号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-吾同-灵活配置分级7号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-天泽-灵活配置分级1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品
国联安-天奕1号资产管理计划	基金管理人管理的专户产品

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

本报告期内与上年度可比期间,本基金与关联方无股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本报告期内与上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.3债券交易

本报告期内与上年度可比期间,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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安	3,647,500,000.00	100.00%	1,319,800,000.00	100.00%

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本报告期内与上年度可比期间,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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,244,364.53	991,138.41
其中:支付销售机构的客户维护费	170,068.39	277,975.41

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	680,110.54	300,344.94

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 2013年1月1日至2013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	26,993.54	4,521.12	31,514.66
国泰君安	1,279.75	–	1,279.75
国联安基金管理有限公司	72,047.36	52,192.55	124,239.91
合计	100,320.65	56,713.67	157,034.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	50,623.16	6,245.39	56,868.55
国泰君安	1,360.63	–	1,360.63
国联安基金管理有限公司	20,829.84	12,984.76	33,814.60
合计	72,813.63	19,230.15	92,043.78

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 2013年1月1日至2013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
国泰君安证券光大银行中海信托定向资产管理计划	–	–	129,850,514.78	300,207.13	–	–

注:本基金上年度可比期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

本报告期内与上年度可比期间,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

国联安货币B

份额单位:份

关联方名称	国联安货币B本期末 2013年12月31日		国联安货币B上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中德安联人寿保险有限公司-省心安益	14,566,415.43	0.37%	9,043,400.07	2.48%
国联安-中都-股指期货趋势分级1号资产管理计划	–	–	29,910,599.36	8.20%
国联安-泓湖CTA资产管理计划	95,527,798.72	2.45%	–	–
国联安-民生-灵活配置分级11号资产管理计划	5,154,334.40	0.13%	–	–
国联安-辉石-债券分级1号特定多客户资产管理计划	6,098,532.57	0.16%	–	–
国联安-民生-灵活配置分级10号资产管理计划	12,105,706.27	0.31%	–	–
国联安-丰利财富-对冲策略3号资产管理计划	31,111,703.08	0.80%	–	–
国联安-中证恒远对冲1号资产管理计划	8,000,000.00	0.21%	–	–
国联安-朱雀-阿尔法8号资产管理计划	35,196,905.15	0.90%	–	–
国联安-泓湖重域-宏观对冲1号资产管理计划	70,547,931.27	1.81%	–	–
国联安-弘尚资产成长精选1号资产管理计划	300,259,255.03	7.71%	–	–
国联安-佰睿吉3号资产管理计划	52,008,092.86	1.34%	–	–
国联安-无花果分级1号资产管理计划	40,280,243.11	1.03%	–	–
国联安-佰睿吉6号资产管理计划	58,107,601.88	1.49%	–	–
国联安-吾同-灵活配置分级7号资产管理计划	72,000,000.00	1.85%	–	–
国联安-天泽-灵活配置分级1号资产管理计划	84,700,000.00	2.18%	–	–
国联安-天奕1号资产管理计划	137,000,000.00	3.52%	–	–

注:中德安联人寿保险有限公司持有的上述基金份额乃根据正常的商业交易条件进行交易,并以一般交易价格为定价基础。

除上表所示外,其他关联方于本年末及上年末均未持有本基金。

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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	266,934,528.67	961,444.01	73,760,984.45	421,668.10

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2013年12月31日的相关余额为人民币1,285,714.29元。于2012年12月31日的相关余额为人民币118,181.82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

本报告期内与上年度可比期间,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

本报告期内与上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。

7.4.9期末(2013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

本基金本报告期末未持有因认购新发和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2013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2013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	239,716,805.26	5.72
	其中:债券	239,716,805.26	5.72
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	1,595,116,894.18	38.06
	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	1,966,220,242.96	46.92
4	其他各项资产	389,828,614.20	9.30
	合计	4,190,882,556.60	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	0.29	
	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	–	–

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	22
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	114
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

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。

注: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	75.93	–
–	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	3.10	–
–	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	5.72	–
–	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.47	–
4	90天(含)—180天	5.73	–
–	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	0.72	–
–	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
–	合计	91.20	–

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	109,743,743.88	2.62
	其中:政策性金融债	109,743,743.88	2.62
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	129,973,061.38	3.10
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	239,716,805.26	5.72
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	19,862,530.00	0.47

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	130210	13国开10	500,000	49,920,678.99	1.19
2	071326001	13兴业证券CP001	200,000	19,999,341.38	0.48
3	071307010	13中信建投CP010	200,000	19,999,098.40	0.48
4	071306008	13安信CP008	200,000	19,997,610.93	0.48
5	071307011	13中信建投CP011	200,000	19,996,859.62	0.48
6	130248	13国开48	200,000	19,980,660.84	0.48
7	100236	10国开36	200,000	19,862,530.00	0.47
8	041363009	13外滩CP001	100,000	10,000,514.74	0.24
9	041353044	13海润CP001	100,000	10,000,191.68	0.24
10	071319002	13东海证券CP002	100,000	9,998,790.46	0.24

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	66
报告期内偏离度的最高值	0.39%
报告期内偏离度的最低值	-0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.13%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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	–
2	应收证券清算款	20,016,446.81
3	应收利息	11,086,552.12
4	应收申购款	358,725,615.27
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	389,828,614.20

§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	1,722	172,932.43	43,167,075.44	14.50%	254,622,577.52	85.50%
国联安货币B	117	33,265,604.43	3,652,325,812.31	93.84%	239,749,906.06	6.16%
合计	1,839	2,278,338.97	3,695,492,887.75	88.20%	494,372,483.58	11.80%

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	137,440.44	0.0462%
	国联安货币B	–	–
	合计	137,440.44	0.0033%

注:1、截止本报告期末,本公司高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含);本公司基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;

2、截止本报告期末,本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§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	1,418,735,986.38	1,427,051,241.81
本报告期期初基金份额总额	46,046,884	364,930,972.77
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	595,626,983.01	5,875,670,333.20
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	343,884,214.05	2,348,525,587.60
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	297,789,652.96	3,892,075,718.37

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、2013年8月14日,基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司股东会第三十五次会议、第三届董事会第四十次会议审议通过,由庹启斌先生担任公司董事长,符学东先生不再担任公司董事长。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[2013]1068号)。

2、2013年5月,基金托管人设立总行资产托管与养老金业务部,承接原资产托管部、养老金部的职责。原资产托管部总经理李桦同志任资产托管与养老金业务部负责人。

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。本基金本报告期末支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为5万元人民币,目前该事务所已向本基金提供连续3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的情况

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	
国泰君安证券股份有限公司	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

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

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
国泰君安证券股份有限公司	–	–	3,647,500,000.00	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
二〇一四年三月三十一日