国联安德盛精选股票证券投资基金

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:华夏银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年三月三十一日

§1 重要提示

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。

基金托管人华夏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	国联安精选股票	
基金主代码	257020	
交易代码	257020	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	
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	
报告期末基金份额总额	3,803,162,577.25份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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。

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	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	郑鹏
	联系电话	021-38992806	010-85238667
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	zhjjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95577
传真		021-50151582	010-85238680

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
本期已实现收益	692,989,593.39	-296,370,586.08	-185,110,419.13
本期利润	568,638,418.00	458,639,023.80	-647,980,609.69
加权平均基金份额本期利润	0.1498	0.1410	-0.2147
本期基金份额净值增长率	17.91%	21.27%	-24.23%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.1118	-0.0679	0.0225
期末基金资产净值	3,605,920,222.39	2,783,884,687.32	2,049,231,038.59
期末基金份额净值	0.948	0.804	0.675

注:1、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。

2、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。

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

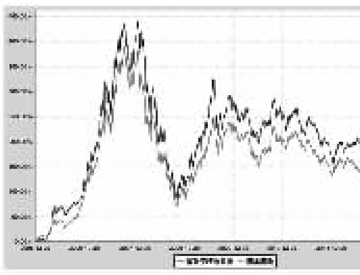
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.73%	1.08%	-2.66%	0.96%	1.93%	0.12%
过去六个月	9.98%	1.24%	5.27%	1.10%	4.71%	0.14%
过去一年	17.91%	1.31%	-5.88%	1.18%	23.79%	0.13%
过去三年	8.34%	1.21%	-20.33%	1.13%	28.67%	0.08%
过去五年	83.06%	1.45%	28.54%	1.32%	54.52%	0.13%
自基金合同生效起至今	284.48%	1.76%	139.47%	1.62%	145.01%	0.14%

注: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
份额累计净值增长率及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12月31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%;

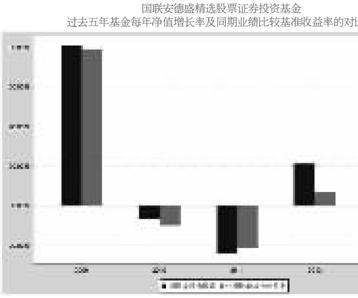
2、本基金基金合同于2005年12月28日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月,2006年6月28日建仓期结束当日除股票投资比例略高于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定;

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、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 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安德盛精选股票证券投资基金
过去五年基金每年净值增长率及同期业绩比较基准收益率的对比图



注: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 过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	-	-	-	-	-
2012年	0.120	16,069,178.96	20,327,061.31	36,396,240.27	-
2011年	0.400	62,672,401.31	62,050,833.60	124,723,234.91	-
合计	0.520	78,741,580.27	82,377,894.91	161,119,475.18	-

注:1、本基金于2012年1月19日实施分红,此次分红的收益分配基准日为2011年12月31日,即实施的是2011年度的利润分配。

2、本基金于2011年3月4日实施分红,此次分红的收益分配基准日为2010年12月31日,即实施的是2010年度的利润分配。

§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		
魏东	本基金基金经理、兼任副总经理和投资总监	2009-09-30	-	17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月起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	2012-03-31	-	8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。曾任浙江金达期货经纪有限公司担任研究员;浙江中大集团投资部投资经理;东方证券股份有限公司研究员。2009年9月起加入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月至2014年1月担任本基金基金经理,2012年5月至2014年1月兼任国联安德盛红利股票证券投资基金基金经理,2012年12月至2014年1月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;

3、施卫平先生于2014年1月9日离任,不再担任本基金基金经理(2014年1月9日公告)。

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 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年沪深300指数下跌约7.6%,中小板指涨幅约17%,创业板指涨近83%,本基金涨幅约18%。考虑到2013年市场在中小板和创业板所存在的巨大机会,本基金的操作还存在一定的遗憾。从全年表现来看,在6月份之前,本基金基本把握了市场的节奏,在成长股上有所斩获;在6月份,本基金逐步将重心转向部分偏价值的蓝筹股,希望相对保守的投资配置可以起到防范风险的作用,但没有避免6月份第一波"钱慌"所造成的损失。在下半年的投资中,本基金对一些重大的主题行情,如去IOE,未判断精准,因此本基金下半年的表现未超越上半年的收益率水平。

4.4.2 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17.91%,同期业绩比较基准收益率为-5.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为,2014年的整体环境对投资的挑战仍然较大。其中主要包括:一是市场利率水平可能持续在相对高位,这对经济的各个环节都将产生更大的压力,一方面是违约风险的出现,另一方面是对股市的资金回报率要求提高;二是发行体制的改革,IPO已经开始,新三板、创业板再融资的推出,从供给端对市场产生压力;三是虽然市场仍然对成长股表现出较高的热情,但其估值水平已经不低,而且从2013年下半年开始就进入简单提升估值而不是业绩预期的阶段,靠市场人气推动的投资存在较大的不确定性。当然,与此同时,我们在传统的银行、地产等低估值板块上也不能看到确定的投资机会,趋势仍不明朗。

因此,我们基金策略是抓住两端,一是坚守具有较好中长期成长性具估值合理的公司,二是积极发掘、适度参与真正具有爆发性机会的个股。稳中求胜,争取给投资者带来较佳收益。

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,以及本基金实际运作情况,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。

本基金以截止至2013年12月31日的可供分配利润为基准,于2014年1月13日实施分红,向截止至2014年1月10日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人,按每10份基金份额0.600元派发红利。共发放红利227,432,201.08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

报告期内,本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,基金管理人在投资运作、基金资产净值计算、利润分配、基金费用开支等方面,能够遵守有关法律法规,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内,,国联安德盛精选股票证券投资基金未进行利润分配。

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

托管人认为,由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2013年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振会计师事务所负责项目的注册会计师石海云、罗琼对国联安德盛精选股票证券投资基金的年度报表出具了无保留意见的审计报告(报告编号:毕马威华振审字第1400198号)。具体内容详见本基金年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:国联安德盛精选股票证券投资基金
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	346,410,107.74	147,938,359.34
结算备付金		4,001,511.29	4,918,704.04
存出保证金		2,947,867.71	1,500,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	3,006,549,882.31	2,588,443,509.68
其中:股票投资		3,006,549,882.31	2,588,443,509.68
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	294,492,761.74	-
应收证券清算款		9,644,612.84	26,495,325.65
应收利息	7.4.7.5	631,767.92	33,108.77
应收股利		-	-
应收申购款		50,065,696.11	51,408,097.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,714,744,207.66	2,820,737,105.08
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		3,066,295.85	26,944,908.18
应付赎回款		96,925,508.15	1,537,376.65
应付管理人报酬		4,429,884.37	3,187,638.74
应付托管费		738,314.08	531,273.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,784,336.31	2,500,657.67
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	879,646.51	2,150,563.39
负债合计		108,823,985.27	36,852,417.76
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,482,080,287.99	2,259,673,942.71
未分配利润	7.4.7.10	1,123,839,934.40	524,210,744.61
所有者权益合计		3,605,920,222.39	2,783,884,687.32
负债和所有者权益总计		3,714,744,207.66	2,820,737,105.08

注:1、报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.948元,基金份额总额3,803,162,577.25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:国联安德盛精选股票证券投资基金
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		652,981,843.26	515,240,824.68
1.利息收入		5,135,230.19	6,044,325.09
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,026,461.06	2,849,238.45
债券利息收入		12,848.75	944,750.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,095,920.38	2,250,336.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		770,269,880.62	-245,879,782.63
其中:股票投资收益	7.4.7.12	734,389,789.07	-265,858,234.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,089,975.45	32,542.06
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	33,790,116.10	19,945,910.04
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-124,351,175.39	755,009,609.88
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	1,927,907.84	66,672.34
减:二、费用		84,343,425.26	56,601,800.88
1.管理人报酬		51,910,473.50	35,331,960.17
2.托管费		8,651,745.63	5,888,660.14
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	23,224,461.46	14,940,180.57
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	556,744.67	441,000.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		568,638,418.00	458,639,023.80
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		568,638,418.00	458,639,023.80

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安德盛精选股票证券投资基金
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)	2,259,673,942.71	524,210,744.61	2,783,884,687.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	568,638,418.00	568,638,418.00
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)	222,406,345.28	30,990,771.79	253,397,117.07
其中:1.基金申购款	1,873,076,941.95	712,431,663.70	2,585,508,605.65
2.基金赎回款	-1,650,670,596.67	-681,440,891.91	-2,332,111,488.58
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,482,080,287.99	1,123,839,934.40	3,605,920,222.39
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)	1,981,072,603.83	68,158,434.76	2,049,231,038.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	458,639,023.80	458,639,023.80
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)	278,601,338.88	33,809,526.32	312,410,865.20
其中:1.基金申购款	431,691,025.30	52,506,805.06	484,197,830.36
2.基金赎回款	-153,089,686.42	-18,697,278.74	-171,786,965.16
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)	-	-36,396,240.27	-36,396,240.27
五、期末所有者权益(基金净值)	2,259,673,942.71	524,210,744.61	2,783,884,687.32

注:报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码从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

国联安德盛精选股票证券投资基金(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")《关于同意德盛精选股票证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2005]188号文)和《关于国联安德盛精选股票证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2005]295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《国联安德盛精选股票证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2005年12月28日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为578,627,467.58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,基金托管人为华夏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安德盛精选股票证券投资基金基金合同》和《国联安德盛精选股票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,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合的比例范围为:股票资产占基金资产的60%-95%;债券、货币市场工具以及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较标准为:沪深300指数×85%+上证国债指数×15%。

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

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

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
华夏银行股份有限公司("华夏银行")	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

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

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	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	1,449,046,197.96	9.47%	285,302,852.48	2.87%

7.4.8.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	1,319,216.88	9.61%	615,646.81	22.14%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	245,387.07	2.87%	26,870.43	1.08%

注:上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》,本基金管理人在租用国泰君安证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时,还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

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	51,910,473.50	35,331,960.17
其中:支付销售机构的客户维护费	3,863,796.69	3,273,738.20

注:支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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×1.5%/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	8,651,745.63	5,888,660.14

注:支付基金托管人华夏银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

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	-	-	98,000,000.00	71,983.01	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间2012年1月1日至2012年12月31日					
	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	-	-	769,800,000.00	478,767.46	-	-

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

本报告期内及上年度可比期间内,基金管理人未投资本基金。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末2013年12月31日		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	120,824,526.54	3.18%	120,824,526.54	3.49%

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,其他关联方于本报告期末及上年度末,均未投资本基金。

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
华夏银行	346,410,107.74	2,800,722.43	147,938,359.34	2,768,886.60

注:本基金通过"华夏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4,001,511.29元。(2012年12月31日:人民币4,918,704.04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

本报告期内及上年度可比期间,本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间,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(2013年12月31日)未持有因认购新发或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(2013年12月31日)未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 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为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	权益投资	3,006,549,882.31	80.94
	其中:股票	3,006,549,882.31	80.94
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	294,492,761.74	7.93
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	350,411,619.03	9.43
6	其他各项资产	63,289,944.58	1.70
7	合计	3,714,744,207.66	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	97,000,000.00	2.69
C	制造业	2,294,799,882.31	63.64
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	179,400,000.00	4.98
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	292,250,000.00	8.10
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	143,100,000.00	3.97
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	3,006,549,882.31	83.38

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	6,180,000	241,514,400.00	6.70
2	000423	东阿阿胶	6,000,000	237,360,000.00	6.58
3	000963	华东医药	3,900,000	179,400,000.00	4.98
4	000651	格力电器	5,200,000	169,832,000.00	4.71
5	600406	国电南瑞	10,000,000	148,700,000.00	4.12
6	002230	科大讯飞	3,000,000	143,550,000.00	3.98
7	000069	华侨城A	27,000,000	143,100,000.00	3.97
8	600309	万华化学	6,700,000	138,690,000.00	3.85
9	600276	恒瑞医药	3,600,000	136,728,000.00	3.79
10	600315	上海家化	3,000,000	126,690,000.00	3.51

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	311,405,838.91	11.19
2	600048	保利地产	218,757,436.48	7.86
3	002230	科大讯飞	196,618,657.34	7.06
4	600016	民生银行	193,330,711.44	6.94
5	000069	华侨城A	183,773,508.27	6.60
6	600837	海通证券	182,660,452.77	6.56
7	601166	兴业银行	176,045,211.17	6.32
8	600741	华域汽车	159,836,799.16	5.74
9	600276	恒瑞医药	158,470,795.96	5.69
10	000651	格力电器	155,321,252.31	5.58
11	600887	伊利股份	154,470,749.35	5.55
12	601117	中国化学	153,413,195.28	5.51
13	000581	威孚高科	147,488,783.04	5.30
14	600583	海油工程	141,666,185.83	5.09
15	600309	万华化学	141,331,318.84	5.08
16	002028	思源电气	139,675,507.40	5.02
17	000100	TCL集团	137,286,662.17	4.93
18	600406	国电南瑞	135,990,964.72	4.88
19	000848	承德露露	135,398,875.83	4.86
20	002701	奥瑞金	133,678,208.54	4.80
21	600372	中航电子	126,540,503.39	4.55
22	600315	上海家化	123,177,711.03	4.42
23	002035	华帝股份	116,759,284.36	4.19
24	600036	招商银行	115,400,902.26	4.15
25	002376	新北洋	114,852,162.00	4.13
26	600332	白云山	114,544,254.19	4.11
27	000963	华东医药	114,359,673.85	4.11
28	000338	潍柴动力	113,379,552.86	4.07
29	600703	三安光电	113,203,721.24	4.07
30	600597	光明乳业	110,397,919.71	3.97
31	600312	平高电气	109,290,553.78	3.93
32	002422	科伦药业	109,176,848.88	3.92
33	000002	万 科A	103,745,731.11	3.73
34	601328	交通银行	101,286,075.10	3.64
35	000063	中兴通讯	100,849,930.45	3.62
36	600549	厦门钨业	100,601,536.77	3.61
37	000731	四川美丰	88,987,945.76	3.20
38	002007	华兰生物	85,016,098.29	3.05
39	600060	海信电器	81,695,754.90	2.93
40	300001	特锐德	79,752,482.16	2.86
41	600518	康美药业	78,341,097.82	2.81
42	002327	富安娜	72,326,971.65	2.60
43	300171	东富龙	71,339,005.49	2.56
44	002477	雏鹰农牧	71,287,933.73	2.56
45	002216	三全食品	68,200,835.76	2.45
46	002511	中顺洁柔	67,111,132.66	2.41
47	600376	首开股份	62,949,814.30	2.26
48	600522	中天科技	61,512,201.27	2.21
49	600000	浦发银行	61,465,454.33	2.21
50	600316	洪都航空	60,259,202.83	2.16
51	002638	勤上光电	59,784,984.23	2.15
52	600387	海越股份	58,930,087.90	2.12
53	002250	联化科技	56,419,713.16	2.03

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	398,825,593.06	14.33
2	601166	兴业银行	389,359,763.20	13.99
3	600048	保利地产	296,054,336.46	10.63
4	000002	万 科A	240,333,614.74	8.63
5	002456	欧菲光	229,973,348.64	8.26
6	600036	招商银行	204,798,556.54	7.36
7	600837	海通证券	191,509,468.16	6.88
8	000100	TCL集团	180,820,000.00	6.50
9	000848	承德露露	176,158,998.97	6.33
10	600406	国电南瑞	173,846,066.81	6.24
11	002376	新北洋	164,561,238.73	5.91
12	000069	华侨城A	159,299,756.12	5.72
13	601117	中国化学	148,548,257.33	5.34
14	600549	厦门钨业	148,259,424.00	5.33
15	600597	光明乳业	138,655,189.20	4.98
16	000581	威孚高科	137,458,868.63	4.94
17	600372	中航电子	137,162,883.05	4.93
18	000963	华东医药	129,942,661.28	4.67
19	600315	上海家化	128,343,843.84	4.61
20	600703	三安光电	128,329,170.94	4.61
21	600060	海信电器	125,280,488.03	4.50
22	600312	平高电气	118,677,451.79	4.26
23	600309	万华化学	115,661,263.44	4.15
24	300001	特锐德	106,668,176.76	3.83
25	600104	上汽集团	105,898,668.37	3.80
26	600887	伊利股份	102,563,398.05	3.68
27	002635	安洁科技	100,924,891.04	3.63
28	300088	长信科技	99,479,976.74	3.57
29	002230	科大讯飞	98,366,574.41	3.53
30	600138	中青旅	97,255,978.97	3.49
31	000338	潍柴动力	93,512,740.71	3.36
32	601328	交通银行	92,833,608.85	3.33
33	600741	华域汽车	83,141,674.37	2.99
34	300142	沃森生物	82,880,521.06	2.98
35	002327	富安娜	81,567,688.12	2.93
36	000661	长春高新	81,205,174.26	2.92
37	300171	东富龙	80,497,577.35	2.89
38	600612	老凤祥	79,638,051.43	2.86
39	002638	勤上光电	74,576,506.37	2.68
40	002477	雏鹰农牧	72,543,726.82	2.61
41	002701	奥瑞金	72,215,284.85	2.59
42	300274	阳光电源	68,875,342.83	2.47
43	300024	机器人	66,665,318.03	2.39
44	600522	中天科技	64,010,662.18	2.30
45	600387	海越股份	63,148,754.08	2.27
46	600276	恒瑞医药	61,541,645.82	2.21
47	002038	双鹭药业	60,439,854.58	2.17
48	600316	洪都航空	60,426,503.17	2.17
49	600583	海油工程	58,475,919.83	2.10
50	300352	北信源	58,448,474.40	2.10
51	600000	浦发银行	57,996,687.73	2.08
52	300168	万达信息	57,567,353.67	2.07

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	7,552,536,189.09
卖出股票的收入(成交)总额	7,744,468,430.14

注:不考虑相关交易费用

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除上海家化外,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。

上海家化(600315)于2013年11月21日发布公告称,于2013年11月20日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌未按照规定披露信息予以立案稽查的《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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	2,947,867.71
2	应收证券清算款	9,644,612.84
3	应收股利	-
4	应收利息	631,767.92
5	应收申购款	50,065,696.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,289,944.58

8.11.4 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。

8.11.5 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。

§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

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
42,992	88,462.10	2,446,668,286.46	64.33%	1,356,494,290.79	35.67%

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	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	4,979.83	0.0001%

注:1、截止本报告期末,本公司高级管理人员、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均为0;

2、截止本报告期末,本基金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

基金合同生效日(2005年12月28日)基金份额总额	578,627,467.58
本报告期期初基金份额总额	3,462,339,578.26
本报告期期间基金总申购份额	2,869,860,144.38
减:本报告期期间基金总赎回份额	2,529,037,145.39
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,803,162,577.25

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。

§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

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)。

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。本基金报告年度支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为12万元人民币,目前该事务所已向本基金提供连续9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等情况

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	
海通证券股份有限公司	1	1,870,304,958.05	12.23%	1,702,721.74	12.40%	-
东方证券股份有限公司	2	1,774,837,305.94	11.60%	1,589,588.79	11.57%	本期新增
光大证券股份有限公司	1	1,600,636,512.27	10.46%	1,416,402.54	10.31%	-
中国银河证券股份有限公司	1	1,572,795,248.39	10.28%	1,391,766.82	10.13%	-
广发证券股份有限公司	2	1,469,920,429.46	9.61%	1,307,704.36	9.52%	本期新增
国泰君安证券股份有限公司	1	1,449,046,197.96	9.47%	1,319,216.88	9.61%	-
安信证券股份有限公司	2	1,260,365,547.35	8.24%	1,119,181.63	8.15%	-
国金证券股份有限公司	1	1,015,721,658.34	6.64%	898,811.18	6.54%	-
中信证券股份有限公司	1	823,811,463.54	5.39%	749,996.82	5.46%	-
中信建投证券有限责任公司	1	752,303,348.70	4.92%	684,890.09	4.99%	本期减少
长江证券股份有限公司	1	639,501,460.88	4.18%	582,203.73	4.24%	本期减少
宏源证券股份有限公司	1	491,237,325.42	3.21%	447,220.15	3.26%	-
齐鲁证券有限公司	1	409,646,050.93	2.68%	372,942.66	2.72%	-
长城证券有限责任公司	1	112,654,057.17	0.74%	102,561.06	0.75%	-
国信证券股份有限公司	1	54,223,054.83	0.35%	49,364.60	0.36%	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	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

1个广发证券股份有限公司的交易单元为本报告期内本基金新租用的交易单元,1个中信建投证券有限责任公司及1个长江证券股份有限公司的交易单元为本报告期内本基金退租的交易单元。

3、由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

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
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	80,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券股份有限公司	16,262,824.20	100.00%	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国联安基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日