

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

【2012】 第三季度报告

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	1,176,195,260.76	99.49
2	其中:股票	1,176,195,260.76	99.49
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
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	5,090,792.90	0.43
6	其他各项资产	896,471.39	0.08
7	合计	1,182,182,525.05	100.00

注:1.权益投资中股票投资金额包含当期计提减值准备增加; 2.其他各项资产中包含当期计提减值准备增加。

5.1.2 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	30,486,530.48	2.58
B	采掘业	779,764,141.97	66.03
C	制造业	365,944,468.31	30.99
C0	食品、饮料	22,575,303.74	1.91
C1	纺织、服装、皮毛	5,321,707.34	0.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,191,328.45	0.61
C4	石油、化学、塑胶、塑料	104,887,259.78	8.88
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	225,968,869.00	19.13
C7	机械、设备、仪器	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,176,195,140.76	99.60

5.2 报告期末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

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五名债券投资明细

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

5.6 报告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

5.7 报告期末本基金投资的股指期货投资明细

5.8 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.9 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.10 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.14 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.16 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.17 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.18 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.19 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.21 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.22 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.23 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.24 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.25 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.26 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.27 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.28 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.29 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.30 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.31 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.32 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.33 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.34 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.35 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.36 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.37 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.38 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.39 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.40 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.41 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.42 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.43 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.44 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.45 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.46 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.47 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.48 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.49 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.50 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.51 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.52 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.53 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.54 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.55 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.56 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.57 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.58 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.59 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.60 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.61 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.62 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.63 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.64 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.65 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.66 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.67 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.68 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.69 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.70 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.71 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.72 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.73 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.74 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.75 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.76 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.77 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.78 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.79 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.80 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.81 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.82 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.83 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.84 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.85 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.86 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.87 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.88 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.89 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.90 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.91 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.92 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.93 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.94 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.95 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.96 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.97 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.98 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.99 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.100 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.11 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.12 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.13 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.14 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.15 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.16 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.17 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.18 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.19 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.20 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.21 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.22 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.23 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.24 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.25 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.26 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.27 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.28 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.29 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.30 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.31 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.32 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.33 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.34 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.35 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.36 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.37 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.38 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.39 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.40 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.41 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.42 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.43 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.44 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.45 报告期末本基金投资的国债期货投资明细

5.46

[illegible]

国联安信心增长定期开

2012

第

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。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，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。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，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

S 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 兼任国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理	2012-2-22	-	8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股份有限公司(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月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理。2012年2月起兼任本基金基金经理。
吴新刊	本基金基金经理 兼任国联安信心增长证券投资基金基金经理	2012-3-31	-	5年(自2007年起)	吴新刊先生, 北京大学经济学硕士。2007年7月至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月在国家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长证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理的任职日期和离任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 报告期内本基金运作遵守信情况说明

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约定和规定, 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

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	50,969,327.00	19.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	240,032,500.00	93.30
5	企业短期融资券	10,170,000.00	3.95
6	中期票据	61,544,000.00	23.92
7	可转债	398,960.00	0.16
8	其他	-	-
9	合计	363,114,787.00	141.15

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	001017	21国债(7)	478,000	50,969,327.00	19.81
2	126018	08江铜债	250,000	21,567,300.00	8.38
3	1182372	11金正大MTN1	200,000	20,692,000.00	8.04
4	1182380	11玖龙MTN1	200,000	20,658,000.00	8.03
5	112068	11棕榈债	200,000	20,600,000.00	8.01

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 投资组合报告附注

5.8.1 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在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。

5.8.2 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各选股库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,415.89
2	应收证券清算款	19,495,269.74
3	应收股利	-
4	应收利息	8,653,434.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,155,120.27

5.8.4 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	110016	10广转债	398,960.00	0.16

5.8.5 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	124,802,904.99	120,938,401.30
报告期期间基金总申购份额	-	-
减: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)	-	-
报告期末基金份额总额	124,802,904.99	120,938,401.30

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 中国证监会批准国联安安心增长定期开放债券型证券投资基金基金发行及募集的文件
- 《国联安安心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 《国联安安心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 《国联安安心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 基金管理人业务资格批件和营业执照
- 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 中国证监会要求的其他文件
- 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
- 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
二〇一二年十月二十五日