

国联安德盛稳健证券投资基金

国联安德盛稳信
【2012】年

22	600519	北方导航	8,157,762.24	4.23
23	002638	顺络电子	8,135,224.41	4.22
24	300105	龙源电力	8,115,139.64	4.20
25	000683	包钢稀土	8,102,376.52	4.20
26	600637	东方通信	9,981,654.33	4.13
27	000036	中航光电	7,982,501.77	4.12
28	000625	长安汽车	7,958,132.98	4.12
29	002436	振华科技	9,242,988.91	4.11
30	600805	航天机电	7,459,458.97	3.88
31	000656	泸州老窖	7,431,845.55	3.85
32	002581	卓胜微电子	7,103,920.18	3.68
33	600166	长城汽车	7,011,466.78	3.63

[illegible]

34	000963	东富药业	6,930,612.34	3.59
35	000866	新华百货	6,746,743.19	3.49
36	002087	新研股份	6,736,201.21	3.49
37	600742	宝胜股份	6,676,729.29	3.46
38	002241	威孚高科	6,633,721.70	3.44
39	600094	大商股份	6,486,897.35	3.36
40	000650	仁和药业	6,484,969.86	3.36
41	500017	同智科技	6,337,207.28	3.28
42	300088	长信科技	6,309,107.86	3.27
43	002430	汉川药业	5,930,556.10	3.07
44	601009	南京银行	5,838,818.27	3.02
45	000349	盛达股份	5,791,157.62	3.00

资产		附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
单位:人民币元				
货币资金				
银行存款	7.4.1		7,027,122.52	11,953,305.48
其他货币资金			347,375.72	102,815.40
存出保单资金			500,000.00	598,780.49
交易性金融资产	7.4.2		131,051,517.26	182,898,876.11
其中:股票投资			96,364,779.76	128,978,407.11
基金投资			—	—
债券投资			34,686,737.50	53,920,469.00
其他权益类投资			—	—

46	002589	康美药业	5,693,385.44	2.95
47	002475	立讯精密	5,661,770.20	2.90
48	600057	银江股份	5,536,962.23	2.87
49	600887	伊利股份	5,530,676.98	2.86
50	000157	中联重科	5,469,442.90	2.83
51	600070	凤凰传媒	5,399,512.33	2.80
52	600011	华能国际	5,382,130.44	2.79
53	601018	华鲁恒升	5,347,826.63	2.77
54	000073	美的集团	5,330,022.67	2.76
55	002086	东方海洋	5,308,528.87	2.74
56	000111	华能水电	5,286,905.00	2.72
57	000999	中信证券	5,244,119.54	2.71

衍生金融资产	747.3	-	-
买入返售金融资产	747.4	-	-
应收未开票应收账款	-	839,029.76	193,549.05
应收账款	747.5	523,779.59	740,630.38
应收股利	-	-	-
应收利息	-	3,754.38	690.83
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	747.6	-	4,412.61
资产总计	-	140,292,578.66	196,492,860.35
负债和所有者权益	附注3	本期末	上年度末
负债：	2012年12月31日	2011年12月31日	2011年12月31日

58	300124	四川港务	4,719,551.65	2.43
59	600268	国电南自	4,718,964.80	2.43
60	600267	海正药业	4,695,943.90	2.44
61	600279	七匹 服	4,673,124.84	2.42
62	600262	南正药业	4,369,237.94	2.26
63	600229	金石开	4,365,196.85	2.26
64	002430	杭新股份	4,248,246.37	2.20
65	600266	中远发展	4,218,268.75	2.18
66	000087	中钢国际	4,133,092.66	2.14
67	300123	太阳海	4,108,153.11	2.13
68	600263	天地科技	3,984,177.34	2.05
69	000070	中航 技	3,954,501.30	2.05

短期借款	-	-
应付票据及应付账款	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付债券	905,241.61	2,061,798.30
应付短期融资款	-	1,351.24
应付长期应付款	19,676.58	1,351.24
应付管理人报酬	165,243.92	224,019.95
应付托管费	27,540.66	42,336.66
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	74,477.76	141,721.28
应付利息	78,483.48	78,483.48

70	600489	中金黄金	3,913,287.15	2.03
71	300115	宝通软件	3,874,200.00	2.03
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			660,415,890.96	
卖出股票的收入(成交)总额			696,006,549.18	
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			金额单位:人民币元	
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)	
1	国家债券	28,029,485.00	20.32	

应付利息		-	-
应付股利		-	-
其他应付款		-	-
其他负债	7.4.7.8	845,526.39	845,005.08
负债合计		2,380,187.40	3,424,718.05
所有者权益		-	-
实收资本	7.4.7.9	162,677,260.49	228,302,427.57
资本公积	7.4.7.10	-24,764,869.21	-35,234,285.37
盈余公积		137,932,391.28	166,868,142.30
未分配利润		140,292,578.68	196,092,860.23
所有者权益合计		-	-

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金资产净值109,848元，基金份额总额162,677,260.49份。

2、报告截止日2015年12月31日，基金资产净值109,848元，基金份额总额162,677,260.49份。

3、本基金资产净值及基金份额总额的数据单位为人民币元，未经审计且未经注册会计师审计。

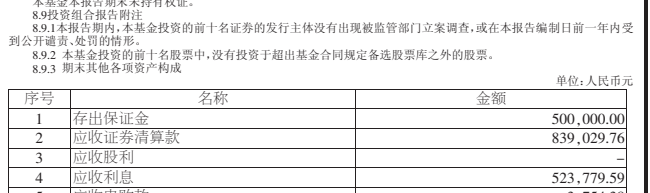
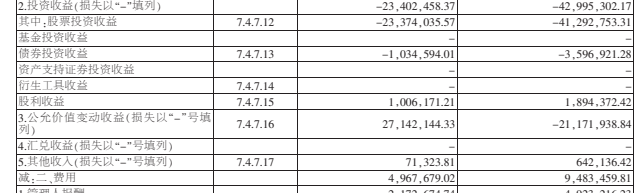
投资者欲了解本基金详细情况，应仔细阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等基金法律文件，并到基金管理人网站及营业网点查阅或索取。

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	可转换	6,657,252.50	4.83
9	其他	-	-
10	合计	34,686,737.50	25.15

8.6 期末按公允价值计量且公允价值变动计入其他综合收益的前五名债券投资明细

单位:人民币元			
项目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年同期 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		5,051,305.28	-61,126,896.79
1.利息收入		1,240,295.51	2,398,207.80
2.手续费及佣金收入	7.4.7.1	76,883.70	180,247.04
3.债券利息收入		1,153,445.00	2,127,960.76
4.资产支持证券利息收入			
5.汇兑收益		9,965.91	
6.其他业务收入			

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	金融资产公允价值占净资产比例(%)
					净产值/人民币元
1	010107	21国债(7)	106,000	11,149,485.00	8.08
2	120002	12国债(国债02)	100,000	9,998,000.00	7.25
3	0100203	03国债(3)	50,000	5,055,000.00	3.84
4	110003	普天转债	37,000	3,911,260.00	2.93
5	110013	国投转债	20,750	2,351,292.50	1.84

[illegible]

5	应收申购款		3,754.38	
6	其他应收款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计		1,866,563.73	

8.9.4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	金额单位：人民币元	
				占基金资产净值比例	
				(%)	
1	113003	重工转债	3,913,860.00		2.84
2	110013	国投转债	2,531,292.50		1.84

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		所有者权益合计
	实收资金	资本公积	
一、期初所有者权益(基金净值)	228,302,427.57	-53,234,285.27	193,068,142.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	83,266.26	83,266.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(本期利息收入、公允价值变动、投资收益、手续费及其他)	-65,625,167.08	10,385,789.80	-55,239,377.28
其中：本期基金申购款	2,213,292.92	-395,086.13	1,818,143.79
2.基金赎回款	-67,838,397.00	10,780,875.93	-57,057,521.07
四、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净利润减少)——“分配利润”	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	162,677,260.49	20,861,269.83	183,538,530.32

8.5.1期末前十名股票集中存在流通受限情况的说明				金额单位:人民币元	
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	000002	万科A	5,097,313.26	3.70	重大资产重组停 牌
9.5期末基金债券持有人户数及持有人结构				69基金资产净值持有人信息	
				金额单位: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		
		占基金总 份额	占基金总 份额		

项目	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
一、所有者权益变动表项目	152,607,299.09	152,607,299.09
1. 所有者投入的资本	-	-
2. 股份支付计入所有者权益的金额	-	-
3. 其他权益变动	-	-
二、利润分配	-	-
1. 提取法定盈余公积	-	-
2. 提取任意盈余公积	-	-
3. 转回法定盈余公积	-	-
4. 转回任意盈余公积	-	-
5. 其他	-	-
三、所有者权益内部结转	-	-
1. 资本公积转增资本(或股本)	-	-
2. 盈余公积转增资本(或股本)	-	-
3. 盈余公积弥补亏损	-	-
4. 其他	-	-
四、所有者权益总额	152,607,299.09	152,607,299.09

	持有份额	持有份额	持有份额			
	比例	比例	比例			
6.547	24,847.60	8,929.32	34.97	54.99	153,747,935.52	94.51
9.6 基金主要财产的构成情况						
9.6.1 基金资产中投资于本基金的投资品种						
1. 截止本报告期末,本基金的投资资产如下:						
2. 截止本报告期末,本基金基金管理人、基金托管人和前十大持有人持有本基金份额的数量区间均为:						
\$10 开放式基金份额变动						
单位:份						
基金合同生效日(2003年8月8日)基金份额总额				3,666,118	147,819	
本报告期期初基金份额总额				228,302	427,57	
本报告期基金总申购份额				2	213,229.92	

[illegible]

本报告期基本金份额总额	67,838,999.49
本报告期末基金份额总额	162,677,260.49
注：总份额指包含本报告期发生的转入和转出数据；总赎回份额指本报告期发生的转出总额。	
11. 重要事件披露	
<p>11.1 基金份额持有人大会决议</p> <p>11.1.1 报告期内基金份额持有人大会决议</p> <p>1. 2012年3月31日，基金管理人召开基金份额持有人大会，经出席会议的基金份额持有人所持表决权三分之二以上通过，并经中国证监会备案，决议如下：自2012年3月31日起，基金管理人将基金名称变更为“嘉实新兴产业股票型证券投资基金”。</p> <p>2. 2012年3月31日，基金管理人召开基金份额持有人大会，经出席会议的基金份额持有人所持表决权三分之二以上通过，并经中国证监会备案，决议如下：自2012年3月31日起，基金管理人将基金名称变更为“嘉实新兴产业股票型证券投资基金”。</p> <p>3. 2012年3月31日，基金管理人召开基金份额持有人大会，经出席会议的基金份额持有人所持表决权三分之二以上通过，并经中国证监会备案，决议如下：自2012年3月31日起，基金管理人将基金名称变更为“嘉实新兴产业股票型证券投资基金”。</p>	

[illegible][illegible][illegible]

11.8 基金管理人调整投资策略的情况。

11.9 基金管理人召开会计师事务所的情况。

11.10 基金管理人聘请会计师事务所的情况。本基金管理人支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 6 万元人民币,且该会计师事务所向本基金提供的是 10% 的审计服务。

11.11 基金管理人及其高级管理人员、托管人及其高级管理人员有违反法律法规及中国证监会规定的行为发生。

11.12 基金和衍生品交易与交易对手有关的情况。

11.13 基金和衍生品交易公司发生破产或投资资金未支付情况。

基金单位,人民币元

券商名称	交易数量	股票交易 成交金额	应支付该券商的佣金	佣金	占当期股票 成交总额的 佣金
					占当期 总金额的

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
上海国联资产管理股份有限公司(“国联资管”)	基金托管人
国联资产管理股份有限公司(“国联资管”)	基金管理人

			前次比例	比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	682,108,255.81	49.26%	570,874.44	49.26%
申银万国证券股份有限公司	1	242,080,216.95	17.85%	211,240.80	18.23%
中国银河证券股份有限公司	2	224,629,854.04	16.56%	195,577.09	16.88%
招商证券股份有限公司	1	126,600,023.00	9.33%	108,284.86	9.34%
中信建投证券股份有限公司	1	81,004,090.24	5.97%	72,919.55	6.29%

安联集团				基金管理人股东
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本报告期内及上年度可比期间的关联方交易				
7.4.9关联交易按照中国证监会发布的《上市公司信息披露管理办法》并予以一般交易价格为定价基础。				
7.4.10通过关联方交易单元进行的交易				全部单位人民币元
7.4.11关联交易				
关联方名称	2012年1月1日至2012年12月31日	占当期股票成交总金额	2011年1月1日至2011年12月31日	占当期股票成交总金额
	成交金额		成交金额	

中国国际金融有限公司	2
注1. 专用交易单元的选择标准如下:	
<p>①选择使用专用交易单元的客户须为证券经纪业务客户提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p> <p>1) 选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p> <p>2) 选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p> <p>3) 选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p>	
<p>②选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p> <p>1) 选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p> <p>2) 选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p> <p>3) 选择使用专用交易单元的客户须为: 证券经纪业务, 且其月交易佣金提供基金买卖证券专用, 选用标准为:</p>	

国泰君安	682,108,255.81	50.29%	1,033,045,898.56	48.78%
7.4.3.1 权证交易 报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。				
7.4.3.2 债券交易				
关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

[illegible]

国泰君安	7,84.14应付关联方佣金	9,202,433.30	9.32%	22,658,975.58	7.99%
关联方名称	本期				
	2012年1月1日至2012年12月31日				
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额的比例	
国泰君安	570,874.44	49.26%	-	-	-
关联方名称	上年同期				
	2011年1月1日至2011年12月31日				
	当期	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额的比例	

基金、报告期内有权限通过中租相关交易单元。

3、由于中租集团利用非交易单元的交易情况，报告期内基金利用证券公司交易单元交易基金无变更。

4、由于中租集团入股，基金交易占比与年初相比存在差异。

11.7.2基金利用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	借券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期借券成交金额的比例	成交金额	占当期回购成交金额的比例	成交金额	占当期权证成交金额的比例
国泰君安证券股份有限公司	9,202,433.30	9.32%	-	-	-	-
银河国证证券股份	35,405,213.20	35.85%	-	-	-	-

国泰君安	佣金	845,788.33	48.09%	39,323.65	27.75%
<p>1. 证券交易费用占拟投资金额的 48.09%，其中：</p> <p>（1）证券交易费用占交易佣金 48.09%，其中：</p> <p>① 沪深证券交易所交易佣金 48.09%；</p> <p>② 深圳证券交易所交易佣金 0.00%；</p> <p>③ 上海证券交易所交易佣金 0.00%；</p> <p>④ 其他交易所交易佣金 0.00%；</p> <p>（2）其他费用占交易佣金 0.00%，其中：</p> <p>① 印花税 0.00%；</p> <p>② 过户费 0.00%；</p> <p>③ 其他费用 0.00%；</p> <p>（3）其他费用占交易佣金 0.00%，其中：</p> <p>① 印花税 0.00%；</p> <p>② 过户费 0.00%；</p> <p>③ 其他费用 0.00%；</p>					
<p>2. 国泰君安证券股份有限公司获得中国证券监督管理委员会核准，开展证券交易专用交易单元进行股票、债券及回购交易的同时，还从国泰君安证券股份有限公司获得证券研究综合服务。</p>					
<p>7.4.2.2 关联方报酬</p>					
<p>7.4.2.2.1 基金管理费</p>					

中国银河证券股份有限公司	-	-	4,600,000.00	21.70%	-	-
招商证券股份有限公司	39,590,880.30	40.09%	5,400,000.00	25.47%	-	-
中信建投证券股份有限公司	14,552,671.40	14.74%	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
<p style="text-align: right;">国联安基金管理有限公司 二〇一三年三月二十七日</p>						