国联安货币市场证券投资基金

【2012】年度报告摘要

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:二〇一三年三月二十七日

§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2013年3月25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2012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	410,977,856.77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	46,046,884份	364,930,972.77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	周倩芝
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	zhouqz@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	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	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
本期已实现收益	2,855,935.08	7,661,323.83	3,751,873.78	7,095,009.89
本期利润	2,855,935.08	7,661,323.83	3,751,873.78	7,095,009.89
本期净值收益率	3.7742%	4.0235%	2.6078%	2.8397%
3.1.2期末数据和指标	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
期末基金资产净值	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

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二年。

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	0.7924%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.4521%	0.0008%
过去六个月	1.5399%	0.0034%	0.6811%	0.0000%	0.8588%	0.0034%
过去一年	3.7742%	0.0073%	1.4178%	0.0002%	2.3564%	0.0071%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.4804%	0.0065%	2.7850%	0.0002%	3.6954%	0.0063%

注:本基金收益分配按日结转份额。

2. 国联安货币B:

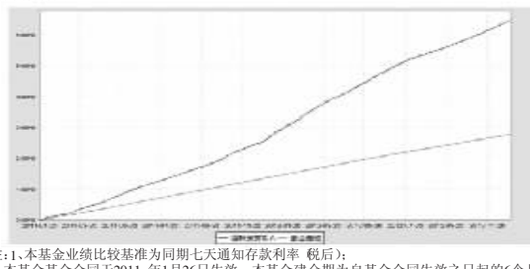
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8536%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.5133%	0.0008%
过去六个月	1.6629%	0.0034%	0.6811%	0.0000%	0.9818%	0.0034%
过去一年	4.0235%	0.0073%	1.4178%	0.0002%	2.6057%	0.0071%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.9774%	0.0065%	2.7850%	0.0002%	4.1924%	0.0063%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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
份额累计净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年1月26日至2012年12月31日)

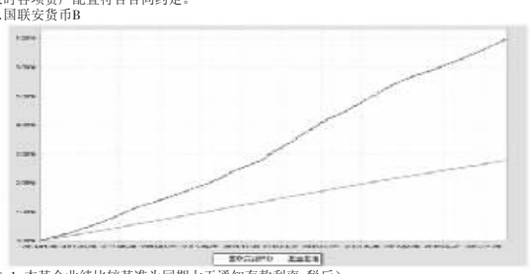
1、国联安货币A



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。

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);

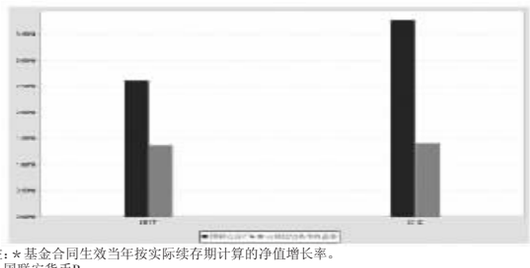
2、本基金基金合同于2011年1月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

3.2.3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

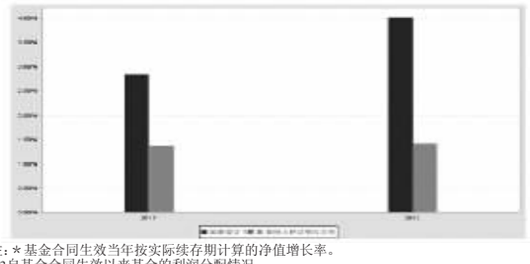
自基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图

1、国联安货币A



注:*基金合同生效当年按实际续存期计算的净值增长率。

2、国联安货币B



注:*基金合同生效当年按实际续存期计算的净值增长率。

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
2012	2,855,935.08	-	-	2,855,935.08	-
2011	3,751,873.78	-	-	3,751,873.78	-
合计	6,607,808.86	-	-	6,607,808.86	-

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。

2、国联安货币B 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
2012	7,661,323.83	-	-	7,661,323.83	-
2011	7,095,009.89	-	-	7,095,009.89	-
合计	14,756,333.72	-	-	14,756,333.72	-

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十八只开放式基金。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	2012-07-11	-	7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。自2010年6月起,加盟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。
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2011-01-26	2012-07-26	12年(自2001年起)	冯俊先生,复旦大学经济学博士。曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管,光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员,长盛基金管理有限公司基金经理助理,泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理。2008年10月起加入国联安基金管理有限公司,现担任债券组合管理部总监,2009年3月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2010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,2011年1月至2012年7月兼任本基金基金经理。
周志远	本基金基金经理助理、兼任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理助理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、债券研究员	2011-01-27	2012-03-22	6年(自2007年起)	-

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。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

2012上半年,经济增速低于历史平均水平,央行下调存款准备金率并降息,受此影响货币市场利率稳中有降,而债券市场有明显上涨趋势。2012年下半年货币当局并没有如市场预期进一步执行宽松的货币政策,而是控制了货币信贷的过快增长,经济有企稳回升的苗头,债券市场开始调整。在此背景下,货币基金首先是保证了资金的流动性,其次是增配了收益率较高、信用风险低的短期融资券品种,以及在市场资金面有变化时适时配置定期存款品种。

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3.7742%,同期业绩比较基准增长率为1.4178%。国联安货币B净值收益率为4.0235%,同期业绩比较基准增长率为1.4178%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观数据显示经济正在温和复苏过程中,宏观政策较为宽松,PMI细项数据显示需求恢复良好。预计2013年上半年经济增长或将持续向上,通货膨胀依然在可控范围内。短期流动性仍处于中性偏宽松的状态,但随着经济的恢复,流动性或将逐步趋紧。在短期资金面宽松的情况下,收益率下行态势可能会由短端向中长端转移;上半年通胀可控及企业利润回升,或将在一定程度上缓解信用风险,有利于信用债的进一步行情。下半年可能面临通胀压力。对于货币基金,中等评级票面较高的信用债品种、定期存款或将是我们的关注对象。

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

根据本基金基金合同的有关约定,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,并以采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。

本报告期内,本基金已实现收益为10,517,258.91元,实际分配收益10,517,258.91元,其中向本基金A级份额持有人分配利润2,855,935.08元,向本基金B级份额持有人分配利润7,661,323.83元,符合本基金基金合同的约定,不存在应分配但尚未实施分配的情况。

§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负责项目的注册会计师王国蓓、黄小熠对国联安货币市场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1300029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:国联安货币市场证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日 单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	268,760,984.45	41,080,354.63
结算备付金		118,181.82	293,181.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	99,655,700.17	50,023,640.30
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资	7.4.7.2	99,655,700.17	50,023,640.30
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	79,000,000.00	26,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,064,674.51	1,029,651.82
应收股利		-	-
应收申购款		4,896,122.56	21,019.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		454,495,663.51	118,447,847.94
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
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		64,783.89	992.56
应付管理人报酬		96,848.77	61,632.39
应付托管费		29,348.14	18,676.50
应付销售服务费		11,414.26	7,678.67
应付交易费用	7.4.7.7	6,072.33	5,904.28
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	329,397.68	366,007.44
负债合计		43,517,806.74	460,891.84
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	410,977,856.77	117,986,956.10
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		410,977,856.77	117,986,956.10
负债和所有者权益总计		454,495,663.51	118,447,847.94

注:1、报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.000元,基金份额总额410,977,856.77份。其中国联安货币A份额为46,046,884.00份;国联安货币B份额为364,930,972.77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:2012年1月1日至2012年12月31日 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	上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入		12,574,094.86	13,556,183.05
1.利息收入		11,293,793.95	12,467,448.89
其中:存款利息收入	7.4.7.11	7,639,731.92	1,774,297.67
债券利息收入		3,170,381.29	4,861,287.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		483,680.74	5,831,863.37
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,280,300.91	1,088,734.16
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	1,280,300.91	1,088,734.16
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		2,056,835.95	2,709,299.38
1.管理人报酬		991,138.41	1,425,050.90
2.托管费		300,344.94	432,312.79
3.销售服务费		220,873.33	437,579.96
4.交易费用	7.4.7.18	-	-
5.利息支出		151,597.50	8,634.17
其中:卖出回购金融资产支出		151,597.50	8,634.17
6.其他费用	7.4.7.19	392,881.77	405,721.56
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		10,517,258.91	10,846,883.67
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-	-

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:2012年1月1日至2012年12月31日 单位:人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011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)	2,845,589,169.30	-	2,845,589,169.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,846,883.67	10,846,883.67
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)	-2,727,602,213.20	-	-2,727,602,213.20
其中:1.基金申购款	914,270,871.20	-	914,270,871.20
2.基金赎回款	-3,641,873,084.40	-	-3,641,873,084.40
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)	-	-10,846,883.67	-10,846,883.67
五、期末所有者权益(基金净值)	117,986,956.10	-	117,986,956.10

注:报表附注为财务报表的组成部分

本报告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。

本基金于2011年1月6日至2011年1月21日募集,募集期间净认购资金人民币2,845,173,610.74元,认购资金在募集期间产生的利息人民币415,558.56元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计2,845,589,169.30份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了KPMG-B(2011)CR No.0002号验资报告。

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2012年12月31日的财务状况、2012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报相一致的说明

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[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、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》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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)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2005年6月13日起,对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税。

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

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011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	1,319,800,000.00	100.00%	16,081,500,000.00	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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	991,138.41	1,425,050.90
其中:支付销售机构的客户维护费	277,975.41	560,230.42

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	300,344.94	432,312.79

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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月26日(基金合同生效日)至2011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	391,817.69	14,724.27	406,541.96
国泰君安	243.19	-	243.19
国联安基金管理有限公司	1,883.59	11,730.04	13,613.63
合计	393,944.47	26,454.31	420,398.78

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