

# 国联安货币市场证券投资基金管理 [2013] 第二季度报告

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：二〇一三年七月十八日

重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性、及时性承担个别及连带责任。

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7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息，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基金，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。

报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 国联安货币

基金主代码 253050

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2011年1月26日

报告期末基金份额总额 231,199,326.18份

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，努力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率的预测，在此基础上，确定组合中货币型品种的配置比例，构建收益曲线形变和无风险套利操作的品种组合，具体包括以下策略：

1. 利率期限策略

2. 收益曲线策略

3. 类属配置策略

4. 现金管理策略

5. 套利策略

6. 小额质押策略

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，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。

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

下属两级基金的基金简称 国联安货币A 国联安货币B

下属两级基金的交易代码 253050 253051

报告期末下属两级基金的份额总额 36,574,866.13份 194,624,460.05份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

国联安货币A 国联安货币B

1.本期已实现收益 337,568.05 2,393,182.04

2.本期利润 337,568.05 2,393,182.04

3.期初基金份额净值 36,574,866.13 194,624,460.05

注：本基金收益分配按日计提份额。

3.1 主要财务指标

报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

国联安货币A 国联安货币B

1.本期已实现收益/收入、不含公允价值变动收益/费用 337,568.05 2,393,182.04

2.本期利润/收入、不含公允价值变动收益/费用 337,568.05 2,393,182.04

3.期初基金份额净值 36,574,866.13 194,624,460.05

4.期末基金份额净值 36,574,866.13 194,624,460.05

5.期末可供分配基金份额利润 0.026% 0.026%

6.期末基金资产净值 0.3366% 0.0000% 0.4362% 0.0026%

注：本基金收益分配按日计提份额。

2.国联安货币B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 0.8334% 0.026% 0.3366% 0.0000%

① 0.4362% ② 0.0026% ③ 0.3366% ④ 0.0000%

注：本基金收益分配按日计提份额。

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

1、国联安货币A

2、国联安货币B

3.2.3 本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

国联安货币A

国联安货币B

注：1、本基金业绩比较基准为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，建仓期间各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币B

阶段 净值增长率(①) 净值增长率差(②) 业绩比较基准收益率(③) 业绩比较基准收益率差(④)

过去三个月 -3.34% -2.64% 1.55% -0.70% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币B市场证券投资基金历史走势对比图

2011年1月26日至2013年6月30日

<div data-bbox="76 985