

国联安德盛小盘精选证券投资基金

[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：中国工商银行股份有限公司

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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2013年7月15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内容，保证复核后的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。

本报告告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国联安小盘精选混合

基金主代码 257010

交易代码 257010

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2004年4月12日

报告期末基金份额总额 2,193,415,160.94份

本基金是一只成长型的股票基金，专注于投资于中国股市市场上成长型的小盘股。基金管理人将充分运用国内外成功的基金管理经验，在严格的风险控制机制下，采用积极主动的投资策略，通过多角度、多层次的基本面研究，充分挖掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会，并通过波段操作的策略追求稳定的资本利得收益，从而实现投资者资产的长期增值。

本基金的投资管理主要分为两个层次：第一个层次是自下而上的行业及个股选择；第二个层次是自上而下的资产配置。

将采取自下而上的方式，使用数量化的金融工具，科学严谨的财务分析和深入的上市公司调研与独特的草根研究等多种手段精选个股，并在此基础上构建股票投资组合。第二个层次是资产类别配置层面的风险管理，即对基金持有的股票、债券等资产类别间的配置进行实时监控，并根据当前宏观环境所处的阶段，动态调整资产配置的比例，达到控制基金风险的目的。总的原则是：本基金在投资管理的各个环节都将是定性研究和定量分析有机结合起来，从而保证投资决策的科学性和风险收益结构的最佳化。

(天相)股票指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%

本基金是一只成长型的股票基金，由于其股票投资组合以小盘股为主，本基金的收益与预期收益率都要高于平衡型基金，同时其投资风格在市场的中高风格品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来高于业绩比较基准的单位风险收益值。

基金管理人 国联安基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

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)

1.本期已实现收益 28,505,348.98

2.本期利润 -57,642,445.18

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0263

4.期末基金份额净值 1,703,298,166.40

5.期末基金份额净值 0.7777

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，不含公允价值变动损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入，包含停牌股票按公允价值调整后的余额。

2.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低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内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 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.12% 1.41% -4.43% 0.88% -1.31% 0.53%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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

国联安德盛小盘精选证券投资基金

累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2004年4月12日至2013年6月30日

注1:本基金业绩比较基准为 天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%

2.本基金合同于2004年4月12日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定。

§ 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

邹新进 本基金基金经理 2010-3-6 - 邹新进先生，硕士，邹新进先生于2004年7月加盟中银基金管理有限公司(前身为中国华泰证券有限责任公司)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、研究副总监、基金经理，2010年3月起担任本基金基金经理，2012年2月至2013年4月兼任国联安信心增长定期开放债券型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.本基金从业人员的证券投资行为符合法律法规的规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《国联安德盛小盘精选证券投资基金合同》及其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责的原则管理好和运用基金财产，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适用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 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

本基金管理人按照相关法律法规和内部制度，制定并完善了国联安基金管理有限公司公平交易制度。以下简称为“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决策结果与评价评估等投资活动相关的各个环节。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获取投资信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会，在公平交易环节中，通过交易系统、交易流程、交易定价和交易记录等环节，对不同投资组合的交易行为进行定期分析，对投资流程实施独立稽核。

4.3.2 平等交易制度的执行情况

本基金报告期内保持了较高的股票仓位，在行业配置上，本基金主要按照季度的投资策略重点配置了部分早周期行业以及成长板业。

4.4 报告期内本基金的业绩表现

本基金报告期内，本基金管理人未对本基金的业绩表现进行单独披露。

4.5 报告期末本基金资产组合情况

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末本基金资产组合情况

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)

1.本期已实现收益 28,505,348.98

2.本期利润 -57,642,445.18

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0263

4.期末基金份额净值 1,703,298,166.40

5.期末基金份额净值 0.7777

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，不含公允价值变动损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入，包含停牌股票按公允价值调整后的余额。

2.上述基金利润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低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期内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 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.12% 1.41% -4.43% 0.88% -1.31% 0.53%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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

国联安德盛小盘精选证券投资基金

累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2004年4月12日至2013年6月30日

注1:本基金业绩比较基准为 天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%

2.本基金合同于2004年4月12日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定。

§ 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

邹新进 本基金基金经理 2010-3-6 - 邹新进先生，硕士，邹新进先生于2004年7月加盟中银基金管理有限公司(前身为中国华泰证券有限责任公司)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、研究副总监、基金经理，2010年3月起担任本基金基金经理，2012年2月至2013年4月兼任国联安信心增长定期开放债券型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.本基金从业人员的证券投资行为符合法律法规的规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《国联安德盛小盘精选证券投资基金合同》及其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责的原则管理好和运用基金财产，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适用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 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

本基金管理人按照相关法律法规和内部制度，制定并完善了国联安基金管理有限公司公平交易制度。以下简称为“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决策结果与评价评估等投资活动相关的各个环节。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获取投资信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会，在公平交易环节中，通过交易系统、交易流程、交易定价和交易记录等环节，对不同投资组合的交易行为进行定期分析，对投资流程实施独立稽核。

4.3.2 平等交易制度的执行情况

本基金报告期内保持了较高的股票仓位，在行业配置上，本基金主要按照季度的投资策略重点配置了部分早周期行业以及成长板业。

4.4 报告期内本基金的业绩表现

本基金报告期内，本基金管理人未对本基金的业绩表现进行单独披露。

4.5 报告期末本基金资产组合情况

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末本基金资产组合情况

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)

1.本期已实现收益 28,505,348.98

2.本期利润 -57,642,445.18

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0263

4.期末基金份额净值 1,703,298,166.40

5.期末基金份额净值 0.7777

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，不含公允价值变动损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入，包含停牌股票按公允价值调整后的余额。

2.上述基金利润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低于所列数字。

3.2.1 本基金报告期内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 净值增长率① 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 -3.12% 1.41% -4.43% 0.88% -1.31% 0.53%

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额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

国联安德盛小盘精选证券投资基金

累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2004年4月12日至2013年6月30日

注1:本基金业绩比较基准为 天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%

2.本基金合同于2004年4月12日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定。

§ 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

邹新进 本基金基金经理 2010-3-6 - 邹新进先生，硕士，邹新进先生于2004年7月加盟中银基金管理有限公司(前身为中国华泰证券有限责任公司)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、研究副总监、基金经理，2010年3月起担任本基金基金经理，2012年2月至2013年4月兼任国联安信心增长定期开放债券型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.本基金从业人员的证券投资行为符合法律法规的规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《国联安德盛小盘精选证券投资基金合同》及其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责的原则管理好和运用基金财产，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适用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 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

本基金管理人按照相关法律法规和内部制度，制定并完善了国联安基金管理有限公司公平交易制度。以下简称为“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决策结果与评价评估等投资活动相关的各个环节。

报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获取投资信息、投资建议和投资决策等方面享有平等机会，在公平交易环节中，通过交易系统、交易流程、交易定价和交易记录等环节，对不同投资组合的交易行为进行定期分析，对投资流程实施独立稽核。

4.3.2 平等交易制度的执行情况

本基金报告期内保持了较高的股票仓位，在行业配置上，本基金主要按照季度的投资策略重点配置了部分早周期行业以及成长板业。

4.4 报告期内本基金的业绩表现