

2013年8月24日 星期六

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：二〇一三年八月二十四日

重要提示及目录

基金管理人、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。本基金年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，由基金托管人复核。

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财产，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请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本报告期未向基金份额持有人披露摘要部分摘要将摘要于年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期内基金财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

国联安小盘精选混合

257010

257010

基金运作方式

契约型开放式

2004年4月12日

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

报告期末基金份额总额

2,193,415,160.94份

基金合同延续期

不定期

2.2 基金产品说明

本基金是一只积极成长型股票基金，专注投资于中国A股市场上具有较强潜力的中盘股。

基金管理人将充分利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，充分发掘小盘股所具有的潜在在成长性带来的投资机会，并通过波段操作的择时策略追求较高的收益和利润。

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证券选择。总体上说，对于本基金的投资重点——小盘股而言，将采取自下而上的方式，综合使用数量化的金融工程模型、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，即对基金资产在股票、债券和现金三大资产类别的配置进行实时监控，并根据当前的宏观经济形势和证券市场价格调整资产配置比例，达到控制基金风险的目的。总之，本基金的投资管理每一个层次都将定性研究和量化分析有机地结合在一起，从而保证投资决策的科学性和风险收益结构的最优化。

本基金是一只积极成长型的股票基金，由于其股票投资组合以小盘股为主，本基金的风险和预期收益都要高于平衡型基金，属于证券投资基金中的高风险品种。本基金力争使基金的单位风险收益指标从长期平均来看不低于业绩比较基准的单位风险收益值。

2.3 基金管理人和基金托管人

基金管理人：国联安基金管理有限公司

蒋松云

信息披露负责人

010-66105798

联系电话

customer.service@gtia-allianz.com

电子邮箱

custody@citic.com

客户服务电话

021-38784766/4007000365

传真

021-50151582

010-66105798

2.4 信息披露方式

基金管理人年度报告正式的管理人互

www.gta-allianz.com或www.vip-funds.com

联网网址

国联安基金管理有限公司

基金管理人年度报告置地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

114,609,542.69

本期已实现收益

62,266,837.10

本期利润

0.0826

加权平均基金份额本期利润

-0.2234

本期基金份额净值增长率

1,703,298,166.40

7.77%

注1：本基金业绩比较基准为：深证小盘股指数×60%+中债盈券指数×40%+上证国债指数×40%。

2.本基金在建仓期(即基金合同生效之日起6个月内，建仓期结束时除货币市场基金以外的其他资产占基金总资产的比例低于50%)，期间可供分配利润、采用未分配利润的表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数。

3.对期末可供分配利润，采用未分配利润的表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

阶段

份额净值增长率
增长率标准差业绩比较基
准收益率准收益率差
额(%)

①-③

②-④

过去一个月

-10.59% 1.80%

-9.34%

1.12%

-1.25%

0.68%

过去三个月

-3.12% 1.41%

-4.43%

0.88%

1.31%

0.53%

过去六个月

3.74% 1.42%

-1.39%

0.86%

5.13%

0.56%

过去一年

4.44% 1.26%

-1.62%

0.83%

6.06%

0.43%

过去三年

13.43% 1.24%

-0.45%

0.88%

12.98%

0.36%

自基金合同生
效起至今

156.86% 1.35%

98.53%

1.20%

58.33%

0.15%

3.2.2 国联安德盛小盘精选证券投资基金基金的历史走势对比图

2004年4月12日至2013年6月30日

注：本基金业绩比较基准为：深证小盘股指数×60%+中债盈券指数×40%+上证国债指数×40%。

2.本基金在建仓期(即基金合同生效之日起6个月内，建仓期结束时除货币市场基金以外的其他资产占基金总资产的比例低于50%)，期间可供分配利润、采用未分配利润的表中未分配利润与本期利润中已实现部分的孰低数。

4 财务报告

4.1 基金管理人对基金经营情况的简要分析

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梯队筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰基金管理有限公司，外方股东为美国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。本报告期内公司管理着二十只开放式基金，国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴国外先进的公司治理和风险管理经验，结合本地化投资研究与客户服务的成功实践，秉持稳健、专业、诚信、透明”的管理理念，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(基金经理)及其基金经理助理的简介

4.1.2.1 基金经理(基金经理)的基本情况

4.1.2.2 基金经理(基金经理)的从业经历

4.1.2.3 基金经理(基金经理)的过往管理基金情况

4.1.2.4 基金经理(基金经理)的薪酬情况

4.1.2.5 基金经理(基金经理)的从业年限

4.1.2.6 基金经理(基金经理)的诚信记录

4.1.2.7 基金经理(基金经理)的证券投资禁业限制情况

4.1.2.8 基金经理(基金经理)的声明

4.1.2.9 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.10 基金经理(基金经理)的其他事项

4.1.2.11 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.12 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.13 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.14 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.15 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.16 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.17 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.18 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.19 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.20 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.21 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.22 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.23 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.24 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.25 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.26 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.27 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.28 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.29 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.30 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.31 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.32 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.33 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.34 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.35 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.36 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.37 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.38 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.39 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.40 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.41 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.42 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.43 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.44 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.45 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.46 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.47 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.48 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.49 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.50 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.51 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.52 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.53 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.54 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.55 基金经理(基金经理)的其他情况

4.1.2.56 基金经理(基金经理)的其他情况