

国联安优选行业股票型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表
会计主体：国联安优选行业股票型证券投资基金
报告截止日：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	105,214,882.56	105,640,184.91
结算备付金		1,378,833.94	966,595.63
存出保证金		455,571.75	1,000,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	603,770,846.41	669,072,939.65
其中：股票投资		603,770,846.41	669,072,939.65
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	60,450,210.68	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	58,060.81	15,217.22
应收股利		348,284.25	-
应收申购款		10,387,621.65	5,631.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		782,064,312.05	776,700,568.94
负债和所有者权益			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,278,044.91	3,232,889.65
应付赎回款		1,442,056.62	653,089.33
应付管理人报酬		939,611.10	802,745.49
应付托管费		156,601.81	133,790.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,065,393.31	918,285.16
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	190,173.07	1,381,009.54
负债合计		13,071,880.82	7,121,810.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	663,506,905.34	808,861,499.20
未分配利润	6.4.7.10	105,485,525.89	-39,287,340.35
所有者权益合计		768,992,431.23	769,578,758.85
负债和所有者权益总计		782,064,312.05	776,700,568.94

注：1、本报告截止2013年6月30日，基金份额总额663,506,905.34份。
2、本报告期内资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解附注内容，应查阅登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表
会计主体：国联安优选行业股票型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		179,836,991.88	58,771,980.86
1.利息收入		589,389.51	533,197.61
其中：存款利息收入	6.4.7.1.1	534,276.19	438,372.83
债券利息收入		725.91	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		54,387.41	94,824.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		172,343,492.97	-21,566,123.09
其中：股票投资收益	6.4.7.1.2	168,825,615.00	-25,420,873.84
基金投资收益	6.4.7.1.3	146,474.09	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1.4	-	-
股利收益	6.4.7.1.5	3,371,403.88	3,854,750.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1.6	6,360,969.01	79,739,200.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1.7	543,140.39	65,706.00
减：二、费用		12,056,970.88	11,132,918.87
1.管理人报酬		6,306,930.13	5,398,826.84
2.托管费		1,051,155.01	899,804.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.1.8	4,488,099.38	4,628,695.14
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.1.9	210,786.36	205,592.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		167,780,021.00	47,639,061.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		167,780,021.00	47,639,061.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：国联安优选行业股票型证券投资基金
本报告期：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	808,861,499.20	-39,282,740.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	167,780,021.00
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）	-145,354,593.86	-23,011,754.76
其中：1.基金申购款	532,696,418.26	47,460,091.54
2.基金赎回款	-678,051,012.12	-70,471,846.30
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）	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	663,506,905.34	105,485,525.89
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	857,961,133.47	-123,441,545.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,639,061.99
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）	-72,563,958.24	8,536,847.79
其中：1.基金申购款	3,314,985.19	-435,132.83
2.基金赎回款	-76,078,943.43	8,971,980.62
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）	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	785,397,175.23	-67,265,635.88

注：报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告6.1至6.4、财务报表由下列负责人签署：
基金管理人负责人：邵杰平，主管会计工作负责人：李珂，会计机构负责人：仲晓峰

6.4 基金管理人
6.4.1 基金基本情况
国联安优选行业股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金经中国证监会《关于核准国联安优选行业股票型证券投资基金募集申请的批复》（证监许可〔2011〕437号文）批准，由国联安基金管理有限公司（以下简称“国联安基金”）发起设立，基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人股东
中德安联人寿保险有限公司（“中德安联”）	基金管理人股东

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.8.1.1 股票交易
本报告期及上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易
本报告期及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

6.4.8.1.3 支付关联方款项的佣金
本报告期及上年度可比期间，本基金未产生应付支付给关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的基金管理费	6,306,930.13	5,398,826.84

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：
H = E × 1.5% × 当月天数 / 当年天数
H 为基金管理人报酬，E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费
单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,051,155.01	899,804.50

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：
H = E × 0.25% × 当月天数 / 当年天数
H 为基金托管费，E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易
本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.8.4 与关联方投资本基金的情况
本报告期及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2013年6月30日	持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2012年12月31日	持有的基金份额 持有的基金份额占基金总份额的比例
中德安联	19,384,476.21	2.92%	-	-

注：中德安联人寿保险有限公司持有的上述基金份额均根据正常的商业交易条件进行交易，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上期 2012年1月1日至2012年6月30日
中国银行	105,214,882.56	148,709,655.55

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。
2、本基金通过 中国银行基金托管资金专用存款账户”转存于中国银行登记结算有限责任公司

的结算备付金，于2013年6月30日的相关余额为人民币1,378,833.94元。
6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本报告期及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9 利润分配情况
本报告期，本基金未实施利润分配。

6.4.10 期末 2013年6月30日 本基金持有的流通受限证券
6.4.10.1 因认购新发及增发证券于本期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有流通受限证券。

6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌期间	期末 持仓数量(股)	期末 持仓成本	期末 持仓金额	备注
000998	平遥古	2013-05-03	2013-07-08	20,50	493,736	10,051,628.84	10,235,147.28

6.4.10.3 期末持有的正在交易中作为抵押的债券
6.4.10.3.1 资产支持证券
截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元，因此没有作为抵押的债券。

6.4.10.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2013年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期间持有待交易的债券和或在新质押回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	603,770,846.41	77.20

其中：股票 603,770,846.41 77.20
其中：债券 - -
资产支持证券 - -
金融衍生品投资 - -
买入返售金融资产 60,450,210.68 7.73
其中：买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -

2 固定收益投资 603,770,846.41 77.20
其中：债券 - -
资产支持证券 - -
金融衍生品投资 - -
买入返售金融资产 60,450,210.68 7.73
其中：买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -

3 金融衍生品投资 - -
4 买入返售金融资产 60,450,210.68 7.73
其中：买入返售金融资产 - -
其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 106,593,716.50 13.63
6 其他各项资产 11,249,538.46 1.44
7 合计 782,064,312.05 100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合情况（单位：人民币元）

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	29,140,845.72	3.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	350,891,973.35	45.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,934,000.00	0.38
F	批发和零售业	18,047,710.00	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,681,167.11	10.10
J	金融业	30,372,937.00	3.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,482,561.40	1.62
M	科学研究和技术服务业	31,396,495.30	4.08
N	水利、环境和公共设施管理业	58,487,683.95	7.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,731,967.88	3.09
S	综合	603,770,846.41	78.51
合计		603,770,846.41	78.51

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600587	桑德环境	1,149,401	47,631,177.44	6.19

2 002241 歌尔声学 1,260,343 52,737,811.18 5.95
3 000826 桑德环境 290,292 32,118,105.11 4.18
4 002415 海康威视 869,268 30,719,931.12 3.99
5 600016 民生银行 3,544,100 30,372,937.00 3.95

6 600406 国电南瑞 1,739,656 26,779,284.08 3.48
7 002573 国电南瑞 1,619,755 26,369,578.84 3.43
8 300133 华策影视 993,801 23,731,967.88 3.09
9 600703 三安光电 1,199,720 23,562,508.80 3.06
10 002236 大华股份 599,612 22,923,166.76 2.98

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应查阅登载于国联安基金管理有限公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内基金投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	600587	桑德环境	63,613,362.58	8.27

2 600016 民生银行 26,233,558.44 8.09
3 600030 中信证券 52,837,339.57 6.87
4 600387 海越股份 36,240,951.40 4.71

5 002241 歌尔声学 33,977,902.90 4.42
6 002573 国电南瑞 33,686,496.54 4.38
7 001166 兴业银行 31,446,347.53 4.08
8 002415 海康威视 31,396,495.30 4.09

9 601633 长城汽车 30,604,678.73 3.98
10 600157 永泰能源 29,347,900.30 3.81
11 000581 奇安信科 29,166,633.34 3.79
12 600703 三安光电 27,451,008.52 3.57

13 001332 广州药业 25,779,212.25 3.35
14 000028 国药一致 23,778,606.59 3.14
15 600352 浙江广厦 21,515,322.21 2.82
16 603000 人元网盛 24,428,482.51 3.17

17 600309 万华化学 24,418,854.16 3.17
18 600406 国电南瑞 23,277,569.48 3.02
19 600108 亚细亚 22,284,826.55 2.90
20 000423 东阿阿胶 22,040,201.56 2.86

21 600587 海康威视 21,131,496.64 2.75
22 300115 长高精密 20,630,135.37 2.68
23 600261 阳光照明