国联安双禧中证100指数分级证券投资基金

【2014】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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月十八日

§1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安双禧中证100指数分级（场内简称：双禧100）		
基金主代码	162509		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2010年4月16日		
报告期末基金份额总额	2,281,009,720.47份		
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，为投资者提供一个投资中证100指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。		
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对中证100指数的有效跟踪。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	95%×中证100指数收益率+5%×活期存款利率（税后）		
基金管理人	国联安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属三级基金的基金简称	国联安双禧A中证100指数（场内简称：双禧A）	国联安双禧B中证100指数（场内简称：双禧B）	国联安双禧中证100指数（场内简称：双禧100）
下属三级基金的交易代码	150012	150013	162509
报告期末下属三级基金的份额总额	877,541,600.00份	1,316,312,400.00份	87,155,720.47份
下属三级基金的风险收益特征	双禧A：低风险低收益。	双禧B：高风险高收益。	双禧100：本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

§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(2014年4月1日－2014年6月30日)
1.本期已实现收益	－25,999,194.18
2.本期利润	31,519,856.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0136
4.期末基金资产净值	1,944,080,927.73
5.期末基金份额净值	0.852

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

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要低于所列数字。

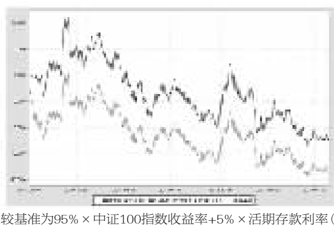
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.55%	0.84%	0.76%	0.86%	0.79%	－0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计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

国联安双禧中证100指数分级证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2010年4月16日至2014年6月30日）



注：1、本基金业绩比较基准为95%×中证100指数收益率+5%×活期存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于2010年4月16日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，2010年10月15日建仓期结束当日除股票投资比例略低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定；

3、本基金于2010年6月18日已基本建仓完毕，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值90%，其他各项资产配置比例自该日起均符合基金合同的约定。由于2010年10月15日有连续大额申购从而导致股票投资比例当日被动未达标，本基金已于2010年10月20日及时调整完毕。

§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
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理	2010－4－16	－	12年（自2002年起）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士。2003年10月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任本基金基金经理，2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013年6月起兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理。

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》、《国联安双禧中证100指数分级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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第2季度，宏观经济数据弱势的状态依旧没有明显的改变，GDP增速、投资、消费等数据仍旧处于低位。中证100指数在2季度出的一波反弹之后，指数震荡下行；整个季度来看指数略微上涨。从中证100指数的各个板块表现来看，2季度保险、建筑等行业表现较好，有色、医药、食品等行业表现较差。

依据基金合同的约定，本基金始终保持较高的仓位，采用完全复制的方法跟踪中证100指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为0.852元，本报告期份额净值增长率为1.55%，同期业绩比较基准收益率为0.76%。本报告期内，日均跟踪偏离度为0.06%，年化跟踪误差为1.24%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%，以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,806,669,713.05	92.79
	其中：股票	1,806,669,713.05	92.79
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	10,000,000.00	0.51
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	120,077,347.59	6.17
7	其他资产	10,224,553.49	0.53
8	合计	1,946,971,614.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采矿业	112,060,989.47	5.76
C	制造业	528,327,007.13	27.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,680,165.70	3.02
E	建筑业	61,860,405.84	3.18
F	批发和零售业	15,955,592.80	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	53,552,095.48	2.75
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,703,224.81	1.32
J	金融业	846,432,429.23	43.54
K	房地产业	67,885,180.28	3.49
L	租赁和商务服务业	－	－
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	16,585,495.57	0.85
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	－	－
S	综合	19,627,126.74	1.01
	合计	1,806,669,713.05	92.93

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,628,046	103,387,329.64	5.32
2	600036	招商银行	9,061,279	92,787,496.96	4.77
3	600016	民生银行	14,882,906	92,422,846.26	4.75
4	601166	兴业银行	6,276,571	62,954,007.13	3.24
5	600000	浦发银行	6,145,171	55,613,797.55	2.86
6	600030	中信证券	4,321,644	49,526,040.24	2.55
7	000002	万 科A	5,315,098	43,955,860.46	2.26
8	600837	海通证券	4,443,093	40,654,300.95	2.09
9	000651	格力电器	1,321,206	38,909,516.70	2.00
10	601288	农业银行	14,259,100	35,932,932.00	1.85

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除中国平安外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国平安（601318）于2013年10月15日发布公告称，其于2013年5月22日在上海证券交易所网站及国内指定报刊发布了《关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》，披露了其控股子公司平安证券有限责任公司收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，受到中国证券监督管理委员会责令改正、给予警告、罚没收入、暂停保荐业务许可3个月等处罚。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	150,820.24
2	应收证券清算款	10,015,000.00
3	应收股利	－
4	应收利息	26,901.38
5	应收申购款	1,584.78
6	其他应收款	－
7	待摊费用	30,247.09
8	其他	－
9	合计	10,224,553.49

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安双禧A中证100指数(场内简称：双禧A)	国联安双禧B中证100指数(场内简称：双禧B)	国联安双禧中证100指数(场内简称：双禧100)
报告期期初基金份额总额	907,144,108.00	1,360,716,162.00	94,634,399.33
报告期期间基金总申购份额	－	－	11,878,759.61
减：报告期期间基金总赎回份额	－	－	93,363,708.47
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“－”填列)	－29,602,508.00	－44,403,762.00	74,006,270.00
报告期期末基金份额总额	877,541,600.00	1,316,312,400.00	87,155,720.47

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安双禧中证100指数分级证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金合同》
3、《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金招募说明书》
4、《国联安双禧中证100指数分级证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

8.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金

【2014】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：中信银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年七月十八日

§1 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安定期开放债券	
基金运作方式	契约型开放式（本基金自《基金合同》生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次）	
基金合同生效日	2012年2月22日	
报告期末基金份额总额	333,823,276.84份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过积极主动地投资管理，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略、可转债投资策略等积极投资策略，在严格控制流动性风险、利率风险以及信用风险的基础上，主动管理寻找价值被低估的固定收益投资品种，构建及调整固定收益投资组合，以期获得最大化的债券收益；并通过适当参与新股发行申购及增发新股申购等较低风险投资品种，力争获取超额收益。	
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
下属两级基金的交易代码	253060	253061
报告期末下属两级基金的份额总额	257,399,959.84份	76,423,317.00份

注：本基金以定期开放方式运作，其封闭期为自《基金合同》生效之日起（包括《基金合同》生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的第一个封闭期为自《基金合同》生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首期5个工作日的首个开放期，如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的，开放期时间中止计算，在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起，继续计算该开放期时间，直至满足《基金合同》关于开放期的时间要求，即每次打开申购与赎回业务办理时间达到5个工作日。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年，以此类推。

§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(2014年4月1日－2014年6月30日)	
	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
1.本期已实现收益	2,334,327.91	630,268.62
2.本期利润	4,486,059.11	1,264,385.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.0174	0.0165
4.期末基金资产净值	263,564,904.21	77,639,461.18
5.期末基金份额净值	1.024	1.016

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、国联安定期开放债券A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.69%	0.04%	0.75%	0.01%	0.94%	0.03%

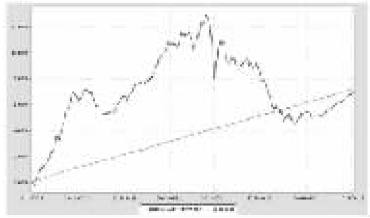
2、国联安定期开放债券B：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	1.70%	0.04%	0.75%	0.01%	0.95%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金
累计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
（2012年2月22日至2014年6月30日）

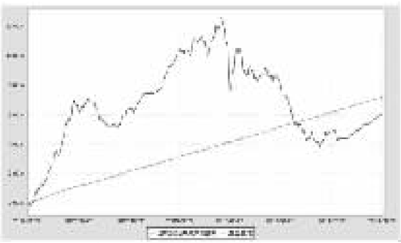
1. 国联安定期开放债券A



注：1、本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率；

2、本基金基金合同于2012年2月22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. 国联安定期开放债券B



注：1、本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率；

2、本基金基金合同于2012年2月22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。

§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
		任职日期	离任日期		
袁新钊	本基金基金经理、兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、国联安保本混合型证券投资基金基金经理、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2012－3－31	－	7年（自2007年起）	袁新钊先生，北京大学经济学硕士。曾任法国巴黎银行(中国)有限公司固定收益产品研究员；国泰君安证券股份有限公司研究员助理、研究员。2011年4月起加入国联安基金管理有限公司，曾担任基金经理助理。2012年3月起担任本基金基金经理。2012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，2013年4月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理，2014年6月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。
李广瑜	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助理	2013－12－25	－	5年（自2009年起）	李广瑜先生，硕士研究生，注册金融分析师(CFA)、金融风险管理师(FRM)。曾任晨星资讯有限公司分析师，渣打银行有限责任公司国际管理培训生，海富通基金管理有限公司债券投资经理，太平资产管理有限公司债券投资经理。2013年6月起加入国联安基金管理有限公司，2013年6月起担任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理助理，2013年11月起兼任国联安德盛增利债券型证券投资基金基金经理，2013年12月起兼任本基金基金经理。

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》、《国联安信心增长定期开放债券型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 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第二季度，从最新的宏观数据来看，工业企业利润总额增速回落而主营活动利润增速回升，库销比和产成品库存增速继续回升，显示库存状况恶化，仍有待去库存。降价刺激下，房地产销售回暖，但投资意愿低，因此尽管宏观数据有所改善，微观企业数据依然赢弱，显示经济反弹基础并不牢固。上半年由于经济疲软和猪价的反季节下滑，通胀整体处于低位。全年来看，终端需求疲软，产出缺口中性；政策无意大规模刺激，定向宽松意图明显。需求端决定了下半年通货膨胀的压力或将不大。六月末，央行停止正回购后，逆回购有望重启，市场对资金面的担忧正逐步减少。

二季度资金面持续宽松，经济仍处于逐步探底的过程中，在基本面和政策面支撑下，债券市场出现一波较好的行情。由于本基金处于转型期间，因此本基金采取了相对保守的操作思路，在部分高资质中长期债券基础上增加短期债券的配置，为七月份的转型做好流动性准备。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安定期开放债券A的份额净值增长率为1.69%，同期业绩比较基准收益率为0.75%；国联安定期开放债券B的份额净值增长率为1.70%，同期业绩比较基准收益率为0.75%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	－	－
	其中：股票	－	－
2	固定收益投资	380,158,381.10	97.56
	其中：债券	380,158,381.10	97.56
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	2,152,433.86	0.55
7	其他资产	7,338,396.58	1.88
8	合计	389,649,211.54	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
4	企业债券	93,154,340.80	27.30
5	企业短期融资券	281,421,000.00	82.48
6	中期票据	－	－
7	可转债	5,583,040.30	1.64
8	其他	－	－
9	合计	380,158,381.10	111.42

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	071422006	14齐鲁证券CP006	600,000	59,994,000.00	17.58
2	071416007	14华泰证券CP007	500,000	49,990,000.00	14.65
3	041366011	13津保税CP002	400,000	40,416,000.00	11.85
4	041356051	13深地铁CP001	300,000	30,420,000.00	8.92
5	041464010	14华数CP001	300,000	30,183,000.00	8.85

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中除12大康债外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12大康债（112102）的发行主体湖南大康牧业股份有限公司于2013年11月28日发布公告称，2013年9月9日深圳证券交易所公布了关于其信息披露违法违规予以通报批评的《关于对湖南大康牧业股份有限公司及相关当事人给予处分的决定》。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	260,847.62
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	7,077,548.96
5	应收申购款	－
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	7,338,396.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
报告期期初基金份额总额	257,399,959.84	76,423,317.00
报告期期间基金总申购份额	－	－
减：报告期期间基金总赎回份额	－	－
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“－”填列)	－	－
报告期期末基金份额总额	257,399,959.84	76,423,317.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国联安定期开放债券A	国联安定期开放债券B
报告期期初管理人持有的本基金份额	48,595,775.12	－
报告期期间买入总份额	－	－
报告期期间卖出总份额	－	－
报告期期末管理人持有的本基金份额	48,595,775.12	－
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.88	－

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金合同》
3、《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

8.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日

国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金

【2014】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：二〇一四年七月十八日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安新精选混合
基金主代码	000417
交易代码	000417
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月4日
报告期末基金份额总额	2,000,713,762.07份
投资目标	通过投资财务稳健、业绩良好、管理规范的公司，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。 2、股票投资策略 在股票投资上本基金主要根据上市公司获利能力、资本成本、增长能力以及股价的估值水平来进行个股选择。同时，适度把握宏观经济情况进行资产配置。具体来说，本基金通过以下步骤进行股票选择：首先，通过ROIC(Return On Invested Capital)指标来衡量公司的获利能力，通过WACC(Weighted Average Cost of Capital)指标来衡量公司的资本成本；其次，将公司的获利能力和资本成本指标相结合，选择出创造价值的公司；最后，根据公司的成长能力和估值指标，选择股票，构建股票组合。 3、普通债券投资策略 在债券投资上，本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券： 1)信用等级高、流动性好； 2)资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券； 3)在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券； 4)公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。 4、中小企业私募债券投资策略 本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。 5、股指期货投资策略 在股指期货投资上，本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。 6、权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资。 (1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，根据BS模型和溢价率对权证的合理价值做出判断，对价值被低估的权证进行投资。 (2)基于对权证标的股票未来走势的预期，充分利用权证的杠杆比率高的特点，对权证进行单边投资； (3)基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资，或利用权证进行风险对冲。 7、资产支持证券等品种投资策略 资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。 本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，结合蒙特卡洛模拟等数量化方法，对资产支持证券进行定价，评估其内在价值进行投资。 对于监管机构允许基金投资的其他金融工具，本基金将在谨慎分析收益性、风险水平、流动性和金融工具自身特征的基础上进行稳健投资，以降低组合风险，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	沪深300指数×85%+上证国债指数×15%
风险收益特征	本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	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(2014年4月1日－2014年6月30日)
1.本期已实现收益	1,457,036.30
2.本期利润	－2,314,565.31
3.加权平均基金份额本期利润	－0.0011
4.期末基金资产净值	1,998,847,921.40
5.期末基金份额净值	0.999

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

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要低于所列数字。

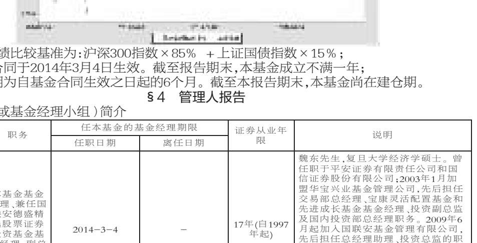
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差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	－0.10%	0.04%	0.93%	0.74%	－1.03%	－0.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2014年3月4日至2014年6月30日）



注：1、本基金业绩比较基准为：沪深300指数×85% ＋上证国债指数×15%；

2、本基金基金合同于2014年3月4日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期。

§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
		任职日期	离任日期		
魏东	本基金基金经理、兼任国联安德盛精选股票证券投资基金基金经理、副总经理和投资总监	2014－3－4	－	17年(自1997年起)	魏东先生，复旦大学经济学硕士。曾任职于平安证券有限责任公司和国信证券股份有限公司；2003年1月加盟华宝兴业基金管理公司，先后担任交易部总经理、宝康灵活配置基金和先进成长基金基金经理、投资副总监及国内投资部总经理职务。2009年6月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任总经理助理、投资总监的职务。2009年9月起担任国联安德盛精选股票证券投资基金基金经理，2009年12月至2011年8月兼任国联安主题驱动股票型证券投资基金基金经理，2014年3月起兼任本基金基金经理。2011年11月起，担任公司副总经理。
周平	本基金基金经理，兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理助理	2014－3－28	－	9年(自2005年起)	周平先生，硕士研究生。曾任职于普华永道(上海)会计师事务所担任审计师、中信资本资产管理有限公司担任分析师。2008年5月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任研究员、基金经理助理职务。2013年12月起担任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理助理，2014年3月起兼任本基金基金经理。

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》、《国联安新精选灵活配置混合型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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第二季度宏观经济整体处于平稳状态，各项经济指标波澜不惊，唯预期摇摆不定，市场也表现出了窄幅波动的特征，行业指数中，新兴类行业表现好于传统行业，尤其是TMT及国防军工类行业；预计三季度宏观经依然维持年初以来的胶着状态，难有趋势性的变化，但需要关注地产行业的行情变化及相关产业链的可能风险。

考虑到对市场总体无趋势性机会的判断，二季度本基金做了较为保守的策略，在低仓位稳健配置的基础上，积极参与了新股的申购，取得了较好的效果；预计三季度本基金仍将维持这一策略，但在配置上会增加一些收益较好的债类产品。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为－0.10%，同期业绩比较基准收益率为0.93%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	168,394,485.00	8.37
	其中：股票	168,394,485.00	8.37
2	固定收益投资	529,740,729.25	26.34
	其中：债券	529,740,729.25	26.34
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	1,177,300,135.00	58.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	131,247,138.53	6.53
7	其他资产	4,268,350.42	0.21
8	合计	2,010,950,838.20	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	20,264,277.45	1.01
B	采矿业	－	－
C	制造业	106,349,207.55	5.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	－	－
F	批发和零售业	－	－
G	交通运输、仓储和邮政业	37,671,200.00	1.88
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,254,800.00	0.06
J	金融业	－	－
K	房地产业	－	－
L	租赁和商务服务业	510,000.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	2,345,000.00	0.12
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	－	－
S	综合	－	－
	合计	168,394,485.00	8.42

5.3 报告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(元)	占基金资产净值比例（%）
1	002711	欧浦钢网	980,000	37,671,200.00	1.88
2	603005	晶方科技	899,977	37,538,040.67	1.88
3	300367	东方网力	440,000	37,224,000.00	1.86
4	002714	牧原股份	460,029	20,264,277.45	1.01
5	002415	海康威视	500,000	8,470,000.00	0.42
6	600887	伊利股份	250,000	8,280,000.00	0.41
7	600660	福耀玻璃	300,000	2,520,000.00	0.13
8	600332	白云山	100,000	2,489,000.00	0.12
9	000625	长安汽车	200,000	2,462,000.00	0.12
10	000651	格力电器	80,000	2,356,000.00	0.12

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	－	－
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
4	企业债券	48,244,729.25	2.41
5	企业短期融资券	451,202,000.00	22.57
6	中期票据	30,294,000.00	1.52
7	可转债	－	－
8	其他	－	－
9	合计	529,740,729.25	26.50

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	041451019	14百联集CP001	500,000	50,260,000.00	2.51
2	011419004	14国电SCP004	500,000	50,105,000.00	2.51
2	041452030	14国电集CP003	500,000	50,105,000.00	2.51
2	011411005	14大唐集SCP005	500,000	50,105,000.00	2.51
5	011417004	14华电SCP004	500,000	50,085,000.00	2.51

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	49,221.03
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	3,962,380.61
5	应收申购款	256,748.78
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	4,268,350.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,113,157,153.99
报告期期间基金总申购份额	1,267,160.70
减：报告期期间基金总赎回份额	113,710,552.62
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“－”填列)	－
报告期期末基金份额总额	2,000,713,762.07

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3、《国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

8.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一四年七月十八日