

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:二〇一二年三月二十九日  
§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事、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。本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2012年3月28日复核了本报告期内中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或不实遗漏。

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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务指标的计算,经毕马威华振会计师事务所为基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况		§ 2 基金简介	
基金简称	国联安货币		
基金主代码	253050		
交易代码	253050		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年1月26日		
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		
报告期末基金份额总额	117,986,956.10份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国联安货币A	国联安货币B	
下属分级基金的交易代码	253050	253051	
报告期末下属分级基金的份额总额	25,974,034.38份	92,012,921.72份	
2.2 基金产品说明			
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,定性分析并量化分析相结合,力争为投资者提供稳定的收益。		
	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方向的预测,在此基础上,确定组合久期和类别资产配置比例,把握收益由曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择,具体包括以下策略:		
投资策略	1. 利率预期策略 2. 收益率曲线策略 3. 类属配置策略 4. 现金流管理策略 5. 套利策略 6. 个券选择策略		
业绩比较基准	同期7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产品。在一般情况下,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。		
2.3 基金管理人 和基金托管人			
	基金管理人		基金托管人
名称	国联安基金管理有限公司		上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆茜	周倩芝
	联系电话	021-38992806	021-61618888
	电子邮箱	customer.service@gjia-allian.com.cn	zhongqin@pud.com.cn
客户服务电话	021-38784766/4007000365	95528	
传真	021-50151582	021-63602450	

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元			
3.1.1 期间数据和指标	2011年1月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日	国联安货币A	国联安货币B
本期已实现收益	3,751,873.78	7,095,009.89	
本期净利润	3,751,873.78	7,095,009.89	
本期净收益	2,607.86	2,839.77	

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金净值表现

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;

注:2、上述基金业绩指标包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益要低于所列数字;

注:3、本基金收益分配按日结转份额;

注:4、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:5、基金净值表现

3.2.2 基金净值表现

注:1、本基金业绩比较基准为同期7天通知存款利率(税后)

注:2、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:3、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:4、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:5、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:6、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:7、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:8、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:9、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:10、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:11、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:12、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:13、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:14、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:15、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:16、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:17、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:18、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:19、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:20、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:21、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:22、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:23、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:24、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:25、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:26、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:27、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:28、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:29、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:30、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:31、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:32、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:33、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:34、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:35、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:36、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:37、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:38、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:39、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:40、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:41、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:42、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:43、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:44、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:45、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:46、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:47、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:48、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:49、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:50、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:51、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:52、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:53、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:54、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:55、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:56、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

注:57、本基金合同于2011年1月26日生效,截止至本报告期末本基金成立不满一年;

# 国联安货币市场证券投资基金

## 2011 年度 报告 摘要

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:二〇一二年三月二十九日  
§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事、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。本年度报告经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2012年3月28日复核了本报告期内中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或不实遗漏。

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,也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者在作出投资决策前应先仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务指标的计算,经毕马威华振会计师事务所为基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

本报告期内自2011年1月26日起至12月31日止。

74.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内,本基金未在承销期内参与关联方承销的承销证券。

74.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内,本基金未发生其他关联交易事项。

74.9 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

74.9.1 因认购新发证券导致于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末(2011年12月31日)未持有因认购新发或增发而流通受限的证券。

74.9.2 期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

74.9.3 期末持有的流通受限证券

截至本报告期末(2011年12月31日),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0.00元,此没有作为抵押的债券。

截至本报告期末(2011年12月31日),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0.00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内持有的证券交易所交易的债券或在质押式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。

8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号 项目 金额 占基金总资产的比例(%)

1 固定收益投资 50,023,640.30 42.23

其中:债券 50,023,640.30 42.23

2 买入返售金融资产 26,000,000.00 21.95

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

3 银行存款和结算备付金合计 41,373,536.45 34.93

4 其他各项资产 1,050,671.19 0.89

合计 118,447,847.94 100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号 项目 金额 占基金资产净值比例(%)

1 报告期内债券回购融资余额 0.11

其中:买断式回购融资 - -

2 报告期末债券回购融资余额 124

其中:买断式回购融资 - -