

基金经理人：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  
报告期截止日：2012年3月29日

§ 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人会议的基金份额持有人以及代销机构应当保证本报告的内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金托管人与一亿股以上的股东同属一家公司，根据《基金法》的规定，该股东不得利用其特殊地位影响基金的投资决策。

基金合同存续期间，基金管理人、基金托管人发生变更，但未依法履行公告义务，可能损害基金份额持有人利益的，基金管理人、基金托管人应当承担法律责任。

本报告所披露的数据，未经审计，投资者欲了解详细情况，可阅读年度报告全文。

本报告自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金简介

**2.1 基金基本情况**

基金名称 国联安心增益债券型证券投资基金

基金简称 国联安心增益债券

基金主代码 253030

交易代码 253030

基金运作方式 约定型。本基金合同生效后一年内封闭运作，基金合同生效后一年内不开放申购、赎回。

基金合同生效日 2010年6月22日

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

报告期基金总资产 943,023,026.06亿元

报告期基金总负债 -

报告期基金净值总额 943,023,026.06亿元

基金合同存续期间 2010年6月22日起至2011年6月21日止。自2011年6月22日起，本基金将转为开放式，并进行定期定额投资业务。

**2.2 基金产品说明**

在控制风险和保持资产流动性的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

本基金在综合考虑基金的流动性需求、本基金的风险收益特征及法律法规的前提下，根据对宏观经济、货币政策、财政政策以及货币市场和股票市场对投资标的和风险的分析，在法规及基金合同规定的比例限制内，动态调整现金类资产、债券类资产和权益类资产的比例，追求较低风险下的较高综合收益。

本基金主要采取利率策略、信用策略、息差策略等积极投资策略，在严控风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，实现绝对收益。

本基金属于债券型基金，属于证券市场中低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

**2.3 基金管理人和基金托管人**

项目 基金管理人 基金托管人

名称 国联安基金管理有限公司 中信银行股份有限公司

姓名 康康 朱义明

信息披露负责人 电子邮箱 021-38992806 zhuym@ctibank.com

客户服务电话 021-3874866/4007000365 95588

传真 021-5015182 06-65550832

数据披露方式 网址 www.gjia-alliance.com, www.vip-funds.com

基金年度报告备查地点 上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

报告期基金净值 943,023,026.06亿元

**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 2010年6月22日至2010年12月31日

本期已实现收益 35,974,757.11 38,728,272.39

本期利润 -38,536,448.94 99,978,568.04

加权平均基金份额本期利润 -0.0307 0.0525

本期基金份额净值增长率 -4.95% 5.30%

3.1.2 期末数据和指标 2011年末 2010年末

期末可供分配基金份额利润 -0.0416 0.0204

期末基金资产净值 903,776,431.99 2,003,076,996.37

期末总资产 908,536,431.99 2,003,076,996.37

期末负债 908,536,431.99 2,003,076,996.37

期末所有者权益 903,776,431.99 2,003,076,996.37

3.1.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位：人民币元

3.1.4 期间数据和指标 2011年 2010年6月22日至2010年12月31日

本期已实现收益 35,974,757.11 38,728,272.39

本期利润 -38,536,448.94 99,978,568.04

加权平均基金份额本期利润 -0.0307 0.0525

本期基金份额净值增长率 -4.95% 5.30%

3.1.5 期末数据和指标 2011年末 2010年末

期末可供分配基金份额利润 -0.0416 0.0204

期末基金资产净值 903,776,431.99 2,003,076,996.37

期末总资产 908,536,431.99 2,003,076,996.37

期末负债 908,536,431.99 2,003,076,996.37

期末所有者权益 903,776,431.99 2,003,076,996.37

3.2.2 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

(2010年6月22日至2011年12月31日)

3.2.3 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.4 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.5 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.6 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.7 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.8 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.9 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.10 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.11 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.12 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.13 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.14 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.15 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.16 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.17 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.18 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.19 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.20 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.21 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.22 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.23 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.24 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.25 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.26 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.27 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.28 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.29 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.30 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.31 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.32 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.33 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.34 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.35 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.36 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.37 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.38 基金合同生效以来基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金的对比如图

3.2.39 基金合同生效以来基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比