

信息披露 Disclosure

国联安信心增益债券型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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：二〇一四年一月二十二日

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1月20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，保证复核后的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。投资者有风险，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2013年10月1日起至2013年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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，基金份额在满一年后转为开放运作。

基金合同生效日 2010年6月22日
报告期初基金份额总额 550,576,769.75份

投资目标 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益收益。

投资策略 本基金在综合考虑货币基金组合的流动性需求、本金安全和投资回报率的前提下，通过合理的资产配置以及对市场状况的分析，动态调整现金类资产、债券类资产和权益类资产的比例限制，在严格控制风险的前提下，力求在利差和市场失衡提供的投资机会，实现组合增值。

业绩比较基准 中证综合指数×(1-2%) + 银行存款利率(税后)×2% + 打新收益 + 赎回、申购及定期定额投资业务。

§ 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(2013年10月1日-2013年12月31日)

1.本期已实现收益 591,522.10

2.本期利润 -18,555,663.37

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0269

4.期末基金份额净值 543,031,961.81

5.期末基金份额净值 0.986

注：根据基金合同及相关说明，本基金封闭期从2010年6月22日起至2011年6月21日止。自2011年6月22日起，本基金运作方式转为开放式，并打开申购、赎回、申购及定期定额投资业务。

3.2 基金净值增长率及其净值表现

3.2.1 本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 净值增长标准差② 业绩比较基准收益率③ 准收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -2.86% 0.14% -2.68% 0.10% -0.18% 0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化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 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势图 (2010年6月22日至2013年12月31日)

注：1.本基金业绩比较基准为中债综合指数；
2.本基金基金合同期至2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起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

袁新钊 本基金基金经理，兼任国联安心增益债券型证券投资基金、国联安保本混合型证券投资基金基金经理。研究员，2011年4月起加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理，研究员，2012年1月兼任本基金基金经理。2013年1月起兼任国联安心增益债券型证券投资基金基金经理。

注：1.基金经理的任职日期即公司对外公告之日；
2.证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年数。
4.2 管理人对报告期内基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵循相关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投资效果与绩效评估等投资管理活动的相关各个环节。

本基金报告期内，本公司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；如遇指令同时或相近时间存在多个买卖申报时，将按照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；对投资流程独立核算等。

本基金报告期内，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明显超过该证券当日成交量万分之五的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.4 异常交易行为的专项说明

本基金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。

4.5 报告期内基金的投研管理工作分析

2013年第四季度，宏观经济延续了2013年下半年以来的平稳态势，总需求中的固定资产投资和进出口贸易都比较平稳。其中，房地产和基础设施投资变化不大，反而维持了总需求的相对平稳。总需求在仍然存在一些压力，一方面房地产销售进入2013年以来持续回暖，而且市场价格上升，银行信贷政策压缩以及部分城市出台新的调控政策，都会抑制潜在的房地产需求，这会对2014年房地产投资

产生一定的影响。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵循相关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

理过程中涉及的投资效果与绩效评估等投资管理活动的相关各个环节。

本基金报告期内，本公司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；如遇指令同时或相近时间存在多个买卖申报时，将按照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；对投资流程独立核算等。

本基金报告期内，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明显超过该证券当日成交量万分之五的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.7 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.8 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.9 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.10 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.11 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.12 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.13 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.14 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.15 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.16 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.17 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.18 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.19 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.20 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.21 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.22 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.23 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.24 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.25 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.26 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.27 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.28 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.29 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.30 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.31 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.32 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险的前提下，努力使基金份额持有人谋取最大利益。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。

4.33 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、部门规章的的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理好基金资产，在严格控制风险