

国联安德盛优势股票证券投资基金

[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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年一月二十二日

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。

基金托管人和银行理财有限公司根据本基金合同的规定,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的内容,确认复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金的过往绩效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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

2 基金产品概况

基金简称 国联安德盛优势股票

基金主代码 257030

基金运作方式 购买开放式

基金份额总额 559391

基金合同生效日 2007年1月24日

报告期末基金份额总额 878,174,131.96

本基金主要通过投资于具有竞争优势的上市公司所发行的股票与国内依法公开发行的债券,力争在长期内实现较高的资本增值。

投资目标 在充分考虑和评估投资风险的基础上,追求资本增值,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增长。

本基金的过往绩效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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

3 主要财务指标

报告期末基金资产净值 102,910,284.50

本期已实现收益 -32,819,319.86

本期利润 -14,079,497.39

加权平均基金份额本期利润 -0.0160

期末基金资产净值 892,676,750.80

基金份额净值 1.017

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,扣除包含停牌股票按公允价值调整的余额。

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将低于所列数字。

3.基金净值表现

3.1 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

过去三个月 -1.45% 1.42% -2.05% 0.79% 0.60% 0.63%

3.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化图(2007年1月24日至2013年12月31日)

注:1.本基金业绩比较基准为沪深300指数×70%+上证国债指数×30%;

2.本基金合同于2007年1月24日生效。本基金建仓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

韦明亮 本基金基金经理,兼任国联安德盛优势基金基金经理,投资组合理部总监 2011-4-23 -

说明:韦明亮先生,经济学硕士,曾任上海升华投资有限公司研究员,上海国泰投资有限公司研究员,光大证券投资研究所研究员,2006年3月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级分析师,2006年11月担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2010年5月加入国联安基金管理有限公司,先后担任研究副总监,投资组合管理部总监,2010年12月起兼任国联安主动型股票型基金基金经理,2011年4月起兼任本基金基金经理。

注:1.基金经理的任职日期和离任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。

3.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》、《国联安德盛优势股票证券投资基金合同》及相关法律法规、法律、法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和谨慎运作基金财产,在严格控制风险的前提下,为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。

4.2 公平交易专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵循公平交易制度和内部规章,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、研究人员、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绩效评估的投资管理制度相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,对不同投资组合之间优先、价格优先的原则执行指令;如指令价与平均价或相同时市场条件都满足时,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。

本基金报告期内,所有投资组合与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3%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.2.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.2.3 报告期内基金的特定客户交易行为分析

本基金报告期内,无特定客户交易行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵循公平交易制度和内部规章,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、研究人员、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绩效评估的投资管理制度相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,对不同投资组合之间优先、价格优先的原则执行指令;如指令价与平均价或相同时市场条件都满足时,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。

本基金报告期内,所有投资组合与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3%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵循公平交易制度和内部规章,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、研究人员、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绩效评估的投资管理制度相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,对不同投资组合之间优先、价格优先的原则执行指令;如指令价与平均价或相同时市场条件都满足时,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。

本基金报告期内,所有投资组合与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3%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 报告期内基金的特定客户交易行为分析

本基金报告期内,无特定客户交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金管理人秉承“精选个股,精选行业”的投资理念,在把握风险与保持资金流动性的基础上,力争为投资者获取超额收益。在行业配置方面,根据对各资产类别的配置,在此基础上,再根据对各资产类别的风险收益特征的进一步分析预测,制定各自策略。

本基金业绩比较基准为沪深300指数×70%+上证国债指数×30%。

本基金合同于2007年1月24日生效。本基金建仓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。

5 管理人报告

5.1 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

韦明亮 本基金基金经理,兼任国联安德盛优势基金基金经理,投资组合理部总监 2011-4-23 -

说明:韦明亮先生,经济学硕士,曾任上海升华投资有限公司研究员,上海国泰投资有限公司研究员,光大证券投资研究所研究员,2006年3月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级分析师,2006年11月担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2010年5月加入国联安基金管理有限公司,先后担任研究副总监,投资组合管理部总监,2010年12月起兼任国联安主动型股票型基金基金经理,2011年4月起兼任本基金基金经理。

注:1.基金经理的任职日期和离任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。

3.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》、《国联安德盛优势股票证券投资基金合同》及相关法律法规、法律、法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和谨慎运作基金财产,在严格控制风险的前提下,为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。

5.2 备查文件目录

1.中国证监会批准基金设立的文件;2.基金合同;3.基金托管协议;4.基金招募说明书;5.基金代销协议;6.基金销售机构协议;7.基金销售代理协议;8.基金宣传推介材料;9.基金监察稽核报告;10.基金定期报告;11.基金半年度报告提示性公告;12.基金上市交易公告书;13.基金临时公告;14.基金清算报告;15.基金信息披露文件;16.中国证监会要求的其他文件。

注:本基金的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金代销协议、基金销售代理协议、基金宣传推介材料、基金监察稽核报告、基金定期报告、基金半年度报告提示性公告、基金上市交易公告书、基金临时公告、基金清算报告、基金信息披露文件是本基金的重要组成部分,基金管理人、基金托管人、基金销售机构在发售基金时应当向投资人提供;基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金代销协议、基金销售代理协议、基金宣传推介材料、基金监察稽核报告、基金定期报告、基金半年度报告提示性公告、基金上市交易公告书、基金临时公告、基金清算报告、基金信息披露文件自基金合同成立之日起不得修改;基金合同另有约定的除外。

3.基金业绩表现

3.1 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

过去三个月 -4.13% 0.17% -1.20% 0.06% -2.93% 0.11%

3.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变化图(执行份额与历史走势对比图)

注:1.本基金业绩比较基准为沪深300指数×70%+上证国债指数×30%;

2.本基金合同于2007年1月24日生效。本基金建仓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。

6 管理人报告

6.1 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

韦明亮 本基金基金经理,兼任国联安德盛优势基金基金经理,投资组合理部总监 2011-4-23 -

说明:韦明亮先生,经济学硕士,曾任上海升华投资有限公司研究员,上海国泰投资有限公司研究员,光大证券投资研究所研究员,2006年3月加入华宝兴业基金管理有限公司担任高级分析师,2006年11月担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理,2010年5月加入国联安基金管理有限公司,先后担任研究副总监,投资组合管理部总监,2010年12月起兼任国联安主动型股票型基金基金经理,2011年4月起兼任本基金基金经理。

注:1.基金经理的任职日期和离任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。

3.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》、《国联安德盛优势股票证券投资基金合同》及相关法律法规、法律、法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和谨慎运作基金财产,在严格控制风险的前提下,为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。

6.2 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金管理人秉承“精选个股,精选行业”的投资理念,在把握风险与保持资金流动性的基础上,力争为投资者获取超额收益。在行业配置方面,根据对各资产类别的配置,在此基础上,再根据对各资产类别的风险收益特征的进一步分析预测,制定各自策略。

本基金业绩比较基准为沪深300指数×70%+上证国债指数×30%。

本基金合同于2007年1月24日生效。本基金建仓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。

7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人运用固有资金购买、赎回或者买卖本公司管理的基金份额。

7.1 备查文件目录

1.中国证监会批准基金设立的文件;2.基金合同;3.基金托管协议;4.基金招募说明书;5.基金代销协议;6.基金销售机构协议;7.基金宣传推介材料;8.基金监察稽核报告;9.基金定期报告;10.基金半年度报告提示性公告;11.基金上市交易公告书;12.基金临时公告;13.基金清算报告;14.基金信息披露文件;15.中国证监会要求的其他文件。

注:本基金的基金合同、基金托管协议、基金招募说明书、基金代销协议、基金销售机构协议、基金宣传推介材料、基金监察稽核报告、基金定期报告、基金半年度报告提示性公告、基金上市交易公告书、基金临时公告、基金清算报告、基金信息披露文件自基金合同成立之日起不得修改;基金合同另有约定的除外。

7.2 报告期内基金的销售情况

本基金报告期内,无基金销售情况。

7.3 报告期内基金的管理情况

本基金报告期内,无基金管理人员变动情况。

7.4 报告期内基金的估值政策和程序

本基金报告期内,无基金估值政策和程序。

7.5 报告期内基金的会计政策

本基金报告期内,无基金会计政策。

7.6 报告期内基金的财务会计报告

本基金报告期内,无基金财务会计报告。

7.7 报告期内基金的托管费计提情况

本基金报告期内,无基金托管费计提情况。

7.8 报告期内基金的其他重要事项

本基金报告期内,无其他重要事项。

8 备查文件目录</