国联安双力中小板综指分级证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月28日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国联安双力中小板综指分级		
场内简称	国安双力		
基金主代码	162510		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年3月23日		
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		
报告期末基金份额总额	29,736,223.21份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年4月16日		
下属分级基金的基金简称	国联安双力A中小板综指(场内简称:双力A)	国联安双力B中小板综指(场内简称:双力B)	国联安双力中小板综指(场内简称:国安双力)
下属分级基金的交易代码	150069	150070	162510
报告期末下属分级基金的份额总额	11,550,160.00	11,550,161.00	6,635,902.21

2.2 基金产品说明

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小板综合指数的有效工具,从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。		
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股,构建目标组合,实现稳定地跟踪目标指数的目的。		
业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)		
风险收益特征	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。		
下属三级基金的风险收益特征	双力A:低风险低收益。	双力B:高风险高收益。	国安双力: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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆康芸	田青
	联系电话	021-38992806	010-67595096
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
本期已实现收益	1,252,471.66
本期利润	1,061,864.47
加权平均基金份额本期利润	0.0328
本期基金份额净值增长率	2.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1125
期末基金资产净值	31,163,140.44
期末基金份额净值	1.048

注:1、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;

2、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;

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.46%	1.03%	3.83%	1.01%	-0.37%	0.02%
过去三个月	4.38%	1.06%	5.44%	1.03%	-1.06%	0.03%
过去六个月	2.86%	1.25%	4.54%	1.25%	-1.68%	0.00%
过去一年	20.40%	1.31%	25.11%	1.31%	-4.71%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	11.98%	1.30%	15.75%	1.34%	-3.77%	-0.04%

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

国联安双力中小板综指分级证券投资基金
份额累计净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年3月23日至2014年6月30日)

注:1、本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2012年3月23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;

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司,其中方股东为国泰君安证券股份有限公司,是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一;外方股东为德国安联集团,是全球顶级综合性金融集团之一。本报告期内公司管理着二十三只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队,借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验,结合本地投资研究与客户服务的成功实践,秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念,力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄志钢	本基金基金经理、兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理、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助理、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助理	2012-03-23	-	7年(自2007年起)	黄志钢先生,硕士,曾任海通期货担任研究员;国元证券股份有限公司衍生产品部高级经理。2008年10月起加入国联安基金管理有限公司,曾担任金融工程分析师。2010年11月起担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助理,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助理,2012年3月起兼任本基金基金经理,2012年6月起至2013年7月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理,2013年8月起兼任国联安中证医药100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均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》、《国联安双力中小板综指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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,本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超过该证券当日成交量5%的交易次数为1次,是两个投资组合根据不同的投资策略进行的调仓操作。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内,本基金采取市值优先和行业分层的抽样方法来复制中小板综合指数。在处理日常的申购赎回、新增成份股、流通股本变动、成份股长期停牌等事件过程中,综合考虑交易成本、个股和行业权重偏离等因素进行组合调整,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2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1.048元,本报告期份额净值增长率为2.86%,同期业绩比较基准收益率为4.54%。本报告期内,日均跟踪偏离度为0.06%,年化跟踪误差为1.14%,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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年下半年,随着“微刺激”的持续发力,中国经济增长中枢下移将大大延缓,从PMI、工业增加值等指标来看,经济短期企稳。预计全年固定资产投资增速与上半年基本持平或略高,消费增长会企稳回升,在海外经济复苏的大背景下,下半年出口对经济的拉动有望增强,全年GDP增速实现7.5%的目标应该是大概率事件,但实体经济领域的去产能行业和房地产行业下行的压力依旧较大。

在宏观经济长期增长放缓,短期增长企稳反弹的大格局下,预计市场维持区间震荡的格局,但震荡的区间范围较上半年会有所放大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成,并根据业务分工履行相应的职责,所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值工作小组成员1/2以上多数票通过,数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致,估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策,公司和基金托管银行有充分沟通,积极商讨达成一致意见;对于估值结果,公司和基金托管银行有详细的核对流程,达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定及本基金基金合同的约定,本基金(包括双力中小板份额、双力A份额、双力B份额)分级运作期内,不进行收益分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、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、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:国联安双力中小板综指分级证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	1,854,930.79	2,614,478.72
结算备付金		-	-
存出保证金		2,698.57	13,401.52
交易性金融资产	6.4.7.2	29,608,417.67	36,743,237.87
其中:股票投资		29,608,417.67	36,743,237.87
1 基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	65,106.92
应收利息	6.4.7.5	394.16	646.11
应收股利		-	-
应收申购款		494.07	693.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	30,247.09	-
资产总计		31,497,182.35	39,437,564.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		67,845.12	168,779.33
应付管理人报酬		25,281.40	34,212.50
应付托管费		5,561.90	7,526.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,374.48	13,764.21
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	232,979.01	327,890.86
负债合计		334,041.91	552,173.66
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	27,818,972.56	35,731,949.68
未分配利润	6.4.7.10	3,344,167.88	3,153,441.50
所有者权益合计		31,163,140.44	38,885,391.18
负债和所有者权益总计		31,497,182.35	39,437,564.84

注:1、报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.048元,基金份额总额29,736,223.21份。其中国联安双力A中小板综指份额11,550,160.00份;国联安双力B中小板综指份额11,550,161.00份;国联安双力中小板综指份额6,635,902.21份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2利润表

会计主体:国联安双力中小板综指分级证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		1,565,270.43	14,559,285.63
1.利息收入		7,895.26	32,579.48
其中:存款利息收入	6.4.7.11	7,895.26	32,579.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,736,386.91	5,156,705.80
其中:股票投资收益	6.4.7.12	1,505,156.60	4,351,533.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	231,230.31	805,171.90
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-190,607.19	9,196,746.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	11,595.45	173,254.17
减:二、费用		503,405.96	1,453,452.02
1.管理人报酬		168,496.62	678,026.31
2.托管费		37,069.24	149,165.78
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	16,905.42	334,334.14
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	280,934.68	291,925.79
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,061,864.47	13,105,833.61
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,061,864.47	13,105,833.61

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:国联安双力中小板综指分级证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	35,731,949.68	3,153,441.50	38,885,391.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,061,864.47	1,061,864.47
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-7,912,977.12	-871,138.09	-8,784,115.21
其中:1.基金申购款	1,036,843.65	148,559.86	1,185,403.51
2.基金赎回款	-8,949,820.77	-1,019,697.95	-9,969,518.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	27,818,972.56	3,344,167.88	31,163,140.44
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	221,971,490.34	-21,192,683.82	200,778,806.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,105,833.61	13,105,833.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-147,761,971.60	2,875,335.41	-144,886,636.19
其中:1.基金申购款	1,426,443.41	9,348.11	1,435,791.52
2.基金赎回款	-149,188,415.01	2,865,987.30	-146,322,427.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	74,209,518.74	-5,211,514.80	68,998,003.94

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:邵杰军,主管会计工作负责人:李柯,会计机构负责人:仲晓峰

6.4报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1593号文)批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年3月23日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为809,109,186.27份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%-100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本基金的收益分配原则遵循了《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况、2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更,未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入,由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(6) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司(“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无股票交易。

6.4.8.1.2权证交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无权证交易。

6.4.8.1.3债券交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无债券交易。

6.4.8.1.4债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间,本基金与关联方无债券回购交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间,本基金无支付关联方的佣金。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	168,496.62	678,026.31
其中:支付销售机构的客户维护费	11,608.56	43,293.22

注:1、在本基金分级运作期内,支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数;

2、在本基金分级运作期到期后,支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人费前一日基金资产净值0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	37,069.24	149,165.78

注:支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式为:每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间内,本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间,基金管理人未投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末,其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	1,854,930.79	7,849.29	4,469,069.94	31,607.95

注:本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管,按银行同业利率计算。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间,本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间,本基金无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末(2014年6月30日)未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002035	华帝股份	2014-06-27	重大事项停牌	9.89	2014-07-02	10.58	8,286	52,250.74	81,948.54	-
002047	宝鹰股份	2014-06-30	重大事项停牌	4.97	-	-	8,543	28,098.78	42,458.71	-
002071	长城影视	2014-06-30	重大事项停牌	21.57	2014-07-11	23.23	4,782	33,046.71	103,147.74	-
002074	东源电器	2014-03-31	重大事项停牌	7.28	-	-	6,349	39,550.59	46,220.72	-
002100	天康生物	2014-05-27	重大事项停牌	9.82	-	-	10,651	80,627.72	104,592.82	-
002156	通富微电	2014-06-25	重大事项停牌	7.97	2014-07-01	7.90	13,851	72,722.03	110,392.47	-
002167	东方锆业	2013-12-31	重大事项停牌	11.39	2014-07-01	11.10	4,696	88,227.10	53,487.44	-
002180	万力达	2014-06-25	重大事项停牌	17.09	2014-07-03	18.80	1,457	16,373.31	24,900.13	-
002252	上海莱士	2014-06-13	重大事项停牌	63.30	-	-	5,598	77,738.17	354,353.40	-
002306	湘鄂情	2014-06-20	重大事项停牌	5.57	2014-07-29	6.13	10,309	52,472.81	57,421.13	-
002340	格林美	2014-06-26	重大事项停牌	11.19	2014-07-24	11.77	8,294	71,591.23	92,809.86	-
002381	双箭股份	2014-05-29	重大事项停牌	10.84	2014-07-04	11.92	4,459	33,252.87	48,335.56	-
002418	康盛股份	2014-06-13	重大事项停牌	7.55	2014-07-03	7.56	4,408	33,236.32	33,280.40	-
002502	骅威股份	2014-05-13	重大事项停牌	15.03	2014-07-28	14.11	5,324	27,805.28	80,019.72	-
002554	惠博普	2014-06-30	重大事项停牌	10.76	2014-07-01	11.84	4,503	32,572.49	48,452.28	-
002564	张化机	2014-05-26	重大事项停牌	6.35	-	-	9,846	60,619.51	62,522.10	-
002565	上海绿新	2014-06-16	重大事项停牌	8.64	2014-07-07	9.10	9,716	40,191.24	83,946.24	-
002570	贝因美	2014-06-18	重大事项停牌	14.36	-	-	7,710	69,539.05	110,715.60	-
002581	万昌科技	2014-04-21	重大事项停牌	16.65	2014-08-21	18.32	2,644	35,569.73	44,022.60	-
002589	瑞康医药	2014-06-12	重大事项停牌	46.10	2014-07-03	50.71	821	24,192.05	37,848.10	-
002602	世纪华通	2014-06-24	重大事项停牌	24.68	2014-07-02	25.50	2,611	21,484.42	64,439.48	-
002622	永大集团	2014-06-02	重大事项停牌	13.78	2014-08-19	15.16	1,249	17,866.81	17,211.22	-
002629	仁智油服	2014-01-07	重大事项停牌	12.22	2014-07-08	13.44	4,921	53,673.49	60,134.62	-
002635	安洁科技	2014-06-30	重大事项停牌	31.99	2014-08-05	35.19	1,728	53,339.79	55,278.72	-
002638	勤上光电	2014-06-10	重大事项停牌	14.15	2014-07-15	14.75	6,467	77,438.75	91,508.05	-
002647	宏磊股份	2014-06-06	重大事项停牌	11.02	-	-	2,883	28,773.39	31,770.66	-
002681	奋达科技	2014-06-23	重大事项停牌	27.45	-	-	2,210	12,396.79	60,664.50	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,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元,因此没有作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,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和/或在新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。

7 资组合报告

7.1 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	权益投资	29