

国联安中证股劵动态策略指数证券投资基金

【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
重要提示及目录
基金管理人、基金托管人、基金销售机构在基金运作过程中,严格遵守《证券投资基金法》...

有或都具备丰富的行业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值工作小组负责。对于估值数据,基金经理、研究员、投资管理部...

(c) 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。
(1) 对基金收取的股息、红利、利息、股息、红利、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已代扣 20%的个人所得税...

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金基本情况, 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, 基金合同生效日期:2013年6月26日...

2.2 基金业绩说明

基金业绩的比较基准:中证股劵动态策略指数收益率+5%。本基金业绩比较基准为中证股劵动态策略指数收益率+5%,其中,中证股劵动态策略指数收益率以中证股劵动态策略指数收益率+5%为基准...

Table with 3 columns: 项目, 期末, 年初, 基金资产净值, 期末资产净值:89,391,113.56元, 年初资产净值:88,391,113.56元...

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 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, 法定代表人:陆建忠, 陆建忠...

2.4 信息披露方式

信息披露网站:www.gla-fund.com
基金年度报告备置地点:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦

3 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上年同期, 3.1 本期资产净值:89,391,113.56元, 3.2 本期基金份额净值:1.0000元...

3.2 基金净值表现

Table with 3 columns: 阶段, 净值增长率, 业绩比较基准, 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...

注:1.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。
注:2.本基金业绩比较基准为95%×中证股劵动态策略指数收益率+5%×活期存款利率(税后)...

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金基本情况
4.1.1 基金管理人及基金基本情况
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明:基金经理:李利, 基金经理助理:仲晓峰...

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.本基金业绩比较基准为95%×中证股劵动态策略指数收益率+5%×活期存款利率(税后);
注:2.本基金合同于2013年6月26日生效;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

注:1.基金合同于2013年6月26日生效;
注:2.本基金建仓期为自基金合同生效之日起6个月,截至建仓期结束本报告期末不满一年,报告期内2013年12月31日建仓期结束前持有的股票、债券及衍生品投资比例低于合同规定范围内,其他各项资产配置符合合同约定;

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表
单位:人民币元
资产负债表
项目 附注 期末 年初

Table with 3 columns: 项目, 期末, 年初, 货币资金:19,037,910.67, 交易性金融资产:15,440.27, 应收利息:28,388,480.42...

6.2 利润表
单位:人民币元
利润表
项目 附注 本期 上年同期

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年同期, 营业收入:1,746,965.51, 公允价值变动收益:74,862.84, 投资收益:16,491.86...

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元
所有者权益变动表
项目 附注 本期 上年同期

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年同期, 一、投资人:163,488.90, 1.利息收入:158,868.37, 2.公允价值变动收益:5,620.53...

6.4 现金流量表
单位:人民币元
现金流量表
项目 附注 本期 上年同期

Table with 3 columns: 项目, 本期, 上年同期, 经营活动产生的现金流量净额:129,856,616.91, 投资活动产生的现金流量净额:-2,407,595.57, 筹资活动产生的现金流量净额:125,462.92...

6.5 分部报告
6.5.1 按地区报告
6.5.2 按业务报告

6.6 关联方关系及交易
6.6.1 关联方关系
6.6.2 关联交易

6.7 或有事项
6.8 承诺事项
6.9 资产负债表日后事项

6.10 其他重要事项
6.11 补充资料

6.12 其他重要事项
6.13 补充资料

6.14 其他重要事项
6.15 补充资料

6.16 其他重要事项
6.17 补充资料

6.18 其他重要事项
6.19 补充资料

6.20 其他重要事项
6.21 补充资料

6.22 其他重要事项
6.23 补充资料

6.24 其他重要事项
6.25 补充资料

6.26 其他重要事项
6.27 补充资料

6.28 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.28.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.28.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.29 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.29.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.29.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.30 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.30.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.30.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.31 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.31.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.31.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.32 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.32.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.32.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.33 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.33.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.33.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.34 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.34.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.34.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.35 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.35.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.35.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.36 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.36.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.36.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.37 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.37.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.37.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.38 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.38.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.38.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.39 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.39.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.39.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.40 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.40.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.40.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.41 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.41.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.41.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.42 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.42.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.42.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.43 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.43.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.43.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.44 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.44.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.44.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.45 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.45.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.45.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.46 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.46.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.46.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.47 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.47.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.47.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.48 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.48.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.48.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.49 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.49.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.49.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.50 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.50.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.50.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.51 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.51.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.51.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.52 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.52.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.52.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.53 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.53.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.53.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.54 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.54.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.54.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.55 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.55.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.55.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.56 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.56.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.56.2 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.1 累计买入金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1: 601318 中国平安, 1,278,829.27, 0.98...

7.4.2 累计卖出金额超过期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期末基金资产净值比例(%), 1: 601318 中国平安, 1,349,772.65, 1.04...

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 项目, 金额, 买入股票的成本:34,182,953.71, 卖出股票的收入:35,593,130.22

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 国债券, --, --, 2: 央行票据, --, --...

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 国债券, --, --, 2: 央行票据, --, --...

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 01930007, 133国电SCP007, 300,000, 0.24...

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 01930007, 133国电SCP007, 300,000, 0.24...

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 01930007, 133国电SCP007, 300,000, 0.24...

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 01930007, 133国电SCP007, 300,000, 0.24...

7.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 01930007, 133国电SCP007, 300,000, 0.24...

7.12 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%), 1: 01930007, 133国电SCP007, 300,000, 0.24...

8 基金持有人信息

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839...

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839...

8.2 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839...

8.3 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839, 基金份额持有人户数:839...