国联安保本混合型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安保本混合
基金主代码	000058
交易代码	000058
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年4月23日
报告期末基金份额总额	105,629,200.89份
投资目标	本基金采用投资组合保险策略来控制本金损失的风险,力求在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过CPPI(Constant Proportation Portfolio Insurance)恒定比例投资组合保险策略,辅之以TIPP(Time Invariant Portfolio Protection)时间不变性投资组合保险策略,在严格控制风险的前提下,基金管理人进行定量分析,对保本资产和风险资产的投资比例进行优化动态调整,确保投资人的投资本金的安全性。同时,本基金还将通过积极稳健的风险资产投资策略,在一定程度上使保本基金分享股市整体性上涨的好处,力争使基金资产实现更高的增值回报。 如在本基金存续期内市场出现新的金融衍生品且在开放式基金许可的投资范围之内,本基金管理人可以相应调整上述投资策略。
业绩比较基准	税后三年期银行定期存款利率×1.2
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	中海信达担保有限公司

§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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	8,581,608.56
2.本期利润	8,446,735.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.0727
4.期末基金资产净值	120,598,815.61
5.期末基金份额净值	1.142

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,包含你牌股票按公允价值调整的影响;
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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

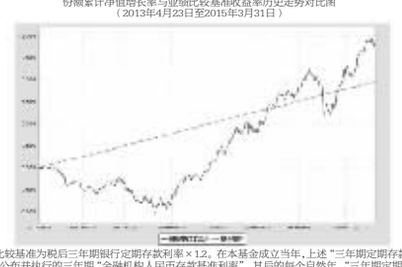
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①-③	②-④
过去三个月	6.63%	0.33%	1.18%	0.02%	5.45%	0.31%

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累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年4月23日至2015年3月31日)



注:1、本基金业绩比较基准为税后三年期银行定期存款利率×1.2。在本基金成立当年,上述“三年期定期存款利率”指《基金合同》生效当日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”,其后的每个自然年,“三年期定期存款利率”指当年第一个工作日中国人民银行公布并执行的三年期“金融机构人民币存款基准利率”;
2、本基金基金合同于2013年4月23日生效;
3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,2013年10月22日建仓期结束当日除现金和逆回购日在一年以内的政府债券的投资比例被动低于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定。本基金已于2013年10月23日及时调整了现金和逆回购日在一年以内的政府债券的投资比例;
4、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
		任职日期	离任日期		
龚新钊	本基金基金经理、兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金经理、国联安债券型证券投资基金基金经理、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理	2013-4-23	-	8年(自2007年起)	龚新钊先生,北京大学经济学硕士。曾任法国巴黎银行(中国)有限公司固定收益产品研究员,国泰君安证券股份有限公司研究员助理、研究员。2011年4月起加入国联安基金管理有限公司,曾担任基金经理助理。2012年3月至2014年12月担任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2012年6月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理,2013年4月起兼任本基金基金经理,2014年6月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

注:1、基金经理的任职日期和离职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。

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》、《国联安保本混合型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 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在一定的跳跳板效应;组合策略以信用债配置为主,通过一定的融资杠杆来获取息差收益。

本基金股票仓位保持稳定,以自下而上选择估值较低的成长股为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为6.63%,同期业绩比较基准收益率为1.18%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	19,669,953.10	13.71
	其中:股票	19,669,953.10	13.71
2	固定收益投资	116,900,389.80	81.48
	其中:债券	116,900,389.80	81.48
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,076,142.09	2.14
7	其他资产	3,829,789.04	2.67
8	合计	143,476,274.03	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,669,953.10	16.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	19,669,953.10	16.31

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	265,279	10,319,353.10	8.56
2	600104	上汽集团	250,000	6,215,000.00	5.15
3	600309	万华化学	130,000	3,135,600.00	2.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	84,871,589.80	70.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	32,028,800.00	26.56
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	116,900,389.80	96.93

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1380325	13资阳水务	200,000	20,884,000.00	17.32
2	1380232	13滨州债	200,000	20,326,000.00	16.85
3	1382161	13渝水投MTN1	200,000	19,952,000.00	16.54
4	112153	12科伦02	150,000	15,108,000.00	12.53
5	122928	09铁岭债	130,000	13,590,200.00	11.27

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告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
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除12科伦02外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12科伦02(112153)的发行主体四川科伦药业股份有限公司于2014年6月5日发布公告称,于2014年6月3日收到中国证券监督管理委员会关于信息披露违法予以行政处罚的《行政处罚决定书》。

12科伦02(112153)的发行主体四川科伦药业股份有限公司于2014年7月7日发布公告称,于2014年7月4日收到中国证券监督管理委员会关于涉嫌信息披露违法违规予以立案调查的《调查通知书》。

12科伦02(112153)的发行主体四川科伦药业股份有限公司于2015年1月29日发布公告称,于2015年1月28日收到中国证监会四川监管局关于信息披露违法予以行政处罚的《行政处罚事先告知书》,对科伦药业给予警告,并处60万元罚款,同时对相关当事人给予警告,并处3万元至30万元罚款。

12科伦02(112153)的发行主体四川科伦药业股份有限公司于2015年2月25日发布公告称,于2015年2月16日收到中国银行间市场交易商协会关于在债务融资工具“11科伦MTN1”、“12科伦MTN1”注册发行前及存续期间存在违反银行间市场相关自律规则指引的行为的《非金融企业债务融资工具市场自律处分意见书》,给予科伦药业警告处分,并处暂停相关业务三个月,责令整改,并在本处分决定生效之日起20个工作日之内向协会提交整改报告。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,973.33
2	应收证券清算款	999,998.40
3	应收股利	-
4	应收利息	2,710,521.22
5	应收申购款	99,296.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,829,789.04

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	124,996,844.34
报告期期间基金总申购份额	3,988,150.90
减:报告期期间基金总赎回份额	23,355,794.35
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	105,629,200.89

注:总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额;总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准国联安保本混合型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安保本混合型证券投资基金基金合同》
3、《国联安保本混合型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安保本混合型证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件
8.2 存放地点
上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
8.3 查阅方式
网址:www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一五年四月二十日

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金

【2015】第一季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安安心成长混合
基金主代码	253010
交易代码	253010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月13日
报告期末基金份额总额	9,143,231,343.82份
投资目标	全程风险预算,分享经济成长,追求绝对收益。
投资策略	本基金的投资管理主要分为两个层次:第一个层次通过全程的风险预算,结合数量化的金融工程模型,根据市场以及基金超额收益率的情况,进行资产配置、行业配置和不同种类债券的配置。第二个层次,在股票投资方面,以价值选股为原则,主要选取基本面好、流动性强、价值被低估的公司,在行业配置基础上进行组合管理;在债券投资方面,注重风险管理,追求稳定收益,基于对中长期宏观形势与利率走势的分析进行久期管理与类属配置,并适量持有可转换债券来构建债券组合。
业绩比较基准	为“德盛安心成长线”,“德盛安心成长线”的确定方式为在基金合同生效时的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365。
风险收益特征	中低风险的基金产品,追求长期的稳定的收益。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2015年1月1日-2015年3月31日)
1.本期已实现收益	311,501,008.38
2.本期利润	300,158,645.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0449
4.期末基金资产净值	5,492,178,438.35
5.期末基金份额净值	0.601

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,包含你牌股票按公允价值调整的影响;
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要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	①-③	②-④
过去三个月	9.18%	0.24%	0.56%	0.01%	8.62%	0.23%

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累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安德盛安心成长混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005年7月13日至2015年3月31日)

注:1、本基金的业绩基准为“德盛安心成长线”,德盛安心成长线的确定:在基金合同生效日的值为0.90元,随着时间的推移每天上涨,在任意一天的斜率为同时期一年期银行存款税后利率除以365;
2、本基金基金合同于2005年7月13日生效。本基金建仓期日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;
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
		任职日期	离任日期		
刘斌	本基金基金经理、兼任国联安德盛稳健证券投资基金、国联安德盛精选股票证券投资基金、国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2013-12-10	2015-3-6	8年(自2007年起)	刘斌先生,硕士研究生。曾任杭州城建设计研究院有限公司工程师;群益国际控股有限公司行业研究员、2009年8月起加入国联安基金管理有限公司,先后担任研究员、基金经理助理,2013年12月至2015年3月担任本基金基金经理,2013年12月起兼任国联安德盛稳健证券投资基金基金经理,2014年2月起兼任国联安德盛精选股票证券投资基金基金经理,2014年6月起兼任国联安通盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
冯俊	本基金基金经理、兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、国联安德盛增利债券证券投资基金、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫盛定开债券型证券投资基金基金经理、国联安鑫安定灵活配置混合型证券投资基金基金经理、债券组合管理部总监	2014-6-13	-	14年(自2001年起)	冯俊先生,复旦大学经济学博士。曾任上海证券有限责任公司研究、交易主管,光大保德信基金管理有限公司资产配置助理、宏观和债券研究员、长盛基金管理有限公司基金经理助理、泰信基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理及基金经理。2008年10月起加入国联安基金管理有限公司,现任债券组合管理部总监。2009年3月至2015年4月担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理,2010年6月至2013年7月兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理,2011年1月至2012年7月兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理,2013年7月起兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理,2014年6月起兼任本基金基金经理,2014年12月起兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理,2015年3月起至今担任国联安鑫安灵活配置混合型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》、《国联安德盛安心成长混合型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 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在一定的跳跳板效应;组合策略以信用债配置为主,通过一定的融资杠杆来获取息差收益。

本基金股票仓位保持稳定,以自下而上选择估值较低的成长股为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为9.18%,同期业绩比较基准收益率为0.56%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	345,246,881.81	6.26
	其中:股票	345,246,881.81	6.26
2	固定收益投资	2,275,464,608.82	41.24
	其中:债券	2,275,464,608.82	41.24
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,157,118,855.68	20.97
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,566,914,821.93	28.40
7	其他资产	172,671,526.02	3.13
8	合计	5,517,416,694.26	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	165,065,579.47	3.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	49,916,389.36	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	25,332,443.58	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,465,704.80	0.39
J	金融业	64,684,164.60	1.18
K	房地产业	17,709,000.00	0.32
L	租赁和商务服务业	1,073,600.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	345,246,881.81	6.29

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600958	东方证券	1,515,589	34,328,090.85	0.63
2	600887	伊利股份	830,000	25,605,500.00	0.47
3	600009	上海机场	1,049,397	25,332,443.58	0.46
4	002727	一心堂	382,158	21,783,006.00	0.40
5	000651	格力电器	480,000	21,014,400.00	0.38
6	601989	中国重工	1,890,000	18,975,600.00	0.35
7	000625	长安汽车	804,600	18,586,260.00	0.34
8	600664	哈药股份	1,800,000	18,522,000.00	0.34
9	000858	五粮液	780,000	18,080,400.00	0.33
10	600109	国金证券	530,000	13,536,200.00	0.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	466,962.00	0.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	179,653,000.00	3.27
	其中:政策性金融债	179,653,000.00	3.27
4	企业债券	798,784,004.02	14.54
5	企业短期融资券	1,093,820,000.00	19.92
6	中期票据	170,057,000.00	3.10
7	可转债	32,683,642.80	0.60
8	其他	-	-
9	合计	2,275,464,608.82	41.43

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0980119	09中核债2	1,000,000	100,390,000.00	1.83
2	071526001	15兴业证券CP001	1,000,000	100,090,000.00	1.82
3	011590004	15苏交通SCP004	1,000,000	100,050,000.00	1.82
4	130202	13国开02	1,000,000	99,950,000.00	1.82
5	011599062	15晋原SCP001	800,000	80,000,000.00	1.46

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。
5.8 报告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
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	274,795.81
2	应收证券清算款	44,087,721.61
3	应收股利	-
4	应收利息	46,260,424.93
5	应收申购款	82,048,083.67
6	其他应收款	500.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	172,671,526.02

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,820,901,717.56
报告期期间基金总申购份额	5,876,872,428.92
减:报告期期间基金总赎回份额	554,542,802.66
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	9,143,231,343.82

注:总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额;总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准国联安德盛安心成长混合型证券投资基金发行及募集的文件
2、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金合同》
3、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金招募说明书》
4、《国联安德盛安心成长混合型证券投资基金托管协议》
5、基金管理人业务资格批件和营业执照
6、基金托管人业务资格批件和营业执照
7、中国证监会要求的其他文件
8.2 存放地点
上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼
8.3 查阅方式
网址:www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一五年四月二十日

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来)

【2015】第一季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年四月二十日

§1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年4月16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。

本报告中财务资料未经审计。

自2015年3月23日至2015年3月31日止,国联安双力中小板综指分级证券投资基金名称变更为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)。原国联安双力中小板综指分级证券投资基金报告期自2015年1月1日至2015年3月23日止,国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)报告期自2015年3月24日至2015年3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

基金简称	国联安双力中小板(LOF)
场内简称	国安双力
基金主代码	162510
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年3月24日
报告期末基金份额总额	17,090,163.10份
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)
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

2.2 原国联安双力中小板综指分级证券投资基金

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		
报告期末基金份额总额	18,332,807.68份		
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)		
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		
下属分级基金的基金简称	国联安双力A中小板综指	国联安双力B中小板综指	国联安双力中小板综指
下属分级基金场内简称	双力A	双力B	国安双力
下属分级基金的交易代码	150069