国联安主题驱动混合型证券投资基金

（原国联安主题驱动股票型证券投资基金）

2015年9月30日

【2015】第三季度报告

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：二〇一五年十月二十六日

§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10月22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。

2015年8月8日，基金管理人公告《国联安基金管理有限公司关于旗下五只基金变更基金名称的公告》，原"国联安主题驱动股票型证券投资基金"更名为"国联安主题驱动混合型证券投资基金"。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安主题驱动混合
基金主代码	257050
交易代码	257050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月26日
报告期末基金份额总额	92,895,163.88份
投资目标	把握中国经济结构转型带来的投资机会，谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	1.资产配置策略 根据宏观经济发展趋势、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。 若出现重大突发事件、投资者情绪急剧变化、海外市场异常变动等因素导致投资决议形成的市场环境发生改变，基金经理可以提出大类资产配置的调整建议，投资决策委员会召开会议，讨论基金经理的建议并确定大类资产的调整比例，由基金经理执行。 2.股票投资策略 本基金股票投资运用主题驱动投资策略。通过"自上而下"的分析方法，前瞻性地挖掘中国经济结构转型过程中涌现的投资主题，结合价值投资理念，精选投资主题下的个股，获取超额收益率。 投资主题是影响经济发展或企业盈利前景的趋势性因素。投资主题是动态的，一般分为四个阶段：主题雏形阶段、主题形成阶段、主题繁荣阶段、主题衰退阶段。 在主题的雏形阶段，对主题的关注度较低，市场反映往往不足；主题繁荣阶段，主题引起广泛关注，市场反映往往过度。这种反应不足和反应过度就带来股票定价的偏差，即主题雏形阶段，股票往往被低估，而到主题繁荣阶段，股票往往被高估。通过对主题过程的把握，利用这种定价偏差，精选主题下的相关个股，在主题雏形阶段买入，在主题繁荣阶段卖出，形成完整的主题驱动投资策略。 3.债券投资策略 在债券投资方面，本基金可投资于国债、央行票据、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本基金采用久期控制下的债券积极投资策略，满足基金流动性要求的前提下实现获得与风险相匹配的投资收益。主要的债券投资策略有： (1)久期控制策略 (2)类属策略 (3)收益率曲线配置策略 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下，进行权证的投资。 (1)综合分析权证的包括执行价格、标的股票波动率、剩余期限等因素在内的定价因素，根据BS模型和隐价率对权证的合理价值做出判断，对价值被低估的权证进行投资； (2)基于对权证标的股票未来走势的预期，充分利用权证的杠杆比率高的特点，对权证进行单边投资； (3)基于权证价值对标的价格、波动率的敏感性以及价格未来走势等因素的判断，将权证、标的股票等金融工具合理配置进行结构性组合投资，或利用权证进行风险对冲。
业绩比较基准	沪深300指数×80%＋上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于较高风险品种，其预期收益水平和风险低于股票型基金，高于债券型基金。
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

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-26,343,640.94
2.本期利润	-43,504,069.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.6896
4.期末基金资产净值	119,738,702.40
5.期末基金份额净值	1.289

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，包含停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	-32.01%	4.79%	-22.79%	2.67%	-9.22%	2.12%

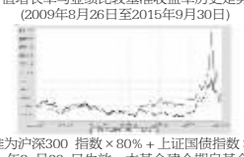
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安主题驱动混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年8月26日至2015年9月30日)



注：1、本基金业绩比较基准为沪深300 指数×80%＋上证国债指数×20%；

2、本基金基金合同于2009 年8 月26 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；

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		
潘明	本基金基金经理、兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金基金经理、国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理。	2015-04-28	-	6年（自2009年起）	潘明，硕士研究生，1996年6月至1998年6月在计算机科学公司担任咨询师；1998年8月至2005年5月在摩托罗拉公司担任高级行政工程师；2003年1月至2003年12月在礼克斯投资管理公司担任投资分析师；2004年4月至2005年5月在短剑投资公司担任执行董事；2005年5月至2009年7月在指导资本公司担任基金经理兼大宗商品研究总监；2009年8月至2010年3月在海通证券股份有限公司担任投资经理；2010年1月至2013年1月在GCS母基金公司、GCS有限公司、GCS有限责任合伙公司担任独立董事；2010年3月至2012年10月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理助理；2012年10月至2013年12月在光大证券资产管理有限公司担任投资经理。2013年12月起加入国联安基金管理有限公司，担任基金经理助理。2014年2月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金基金经理。2015年4月起兼任国联安主题驱动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》、《国联安主题驱动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，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有超过该证券当日成交量5%的情况。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 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

2015年三季度TMT行业呈现集体暴跌的市场状况，计算机和电子等行业跌幅超过30%，波动幅度超过了整体A股市场。TMT行业在九月份开始企稳，慢慢走出股灾的阴影。从上市公司半年报来看，传媒行业业绩略超预期，电子行业业绩符合预期，而计算机行业业绩低于预期。传媒、电子和计算机行业的三季度股价表现差异也基本反映了这些细分行业的业绩分化。本基金认为上半年的互联网金融主题热点有可能在下半年让位给90后文化主题。曾经非主流的90后已经主流化，尤其在文化娱乐消费领域，而曾经主流的70后、80后已经边缘化。90后、甚至00后的新口味、新习惯、新需求、新趋势和新的互联网玩法将带来新的投资机遇。

作为聚焦泛传媒互联网行业的产品，寻找有网感的公司是本基金的投资流程的重要一部分。本基金希望成为一个极具网感的一个产品。网络剧公司一般网感十足，它们对传统电视剧和传统娱乐制作的颠覆性创新值得重视。自媒体的网感度也普遍比较高。涉及网络剧和自媒体的公司是本基金配置的方向之一。本基金的其他主要配置方向包括O2O电商、动漫、院线、数字营销、体育等。

4.4.2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-32.01%，同期业绩比较基准收益率为-22.79%。

§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	102,036,057.17	73.93
	其中：股票	102,036,057.17	73.93
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	35,695,169.15	25.86
7	其他各项资产	292,069.57	0.21
8	合计	138,023,295.89	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

代码	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	57,035,553.85	47.63
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	16,648,761.22	13.90
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,581,848.48	3.83
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	23,769,893.62	19.85
S	综合	-	-
	合计	102,036,057.17	85.22

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	600136	道博股份	219,500	7,228,135.00	6.04
2	002292	奥飞动漫	243,180	7,115,446.80	5.94
3	002488	金固股份	365,200	7,066,620.00	5.90
4	002555	顺荣三七	193,000	6,988,530.00	5.84
5	002739	万达院线	73,000	5,949,500.00	4.97
6	002131	利欧股份	397,983	5,711,056.05	4.77
7	000835	长城动漫	472,084	4,673,631.60	3.90
8	000558	莱茵体育	274,034	4,581,848.48	3.83
9	002188	新 嘉 联	144,700	4,231,028.00	3.53
10	300359	全通教育	45,800	3,589,804.00	3.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	80,137.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,630.40
5	应收申购款	209,301.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	292,069.57

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报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002739	万达院线	5,949,500.00	4.97	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	64,744,456.98
本报告期基金总申购份额	56,242,991.92
减：本报告期基金总赎回份额	28,092,285.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	92,895,163.88

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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主题驱动股票型证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安主题驱动混合型证券投资基金基金合同》

3、《国联安主题驱动混合型证券投资基金招募说明书》

4、《国联安主题驱动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

二〇一五年十月二十六日

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金

2015年9月30日

【2015】第三季度报告

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：二〇一五年十月二十六日

§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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安股债动态
基金主代码	000060
交易代码	000060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月26日
报告期末基金份额总额	3,832,912.43份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争使基金净值增长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0.5%，年化跟踪误差不超过6%，努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金进行被动式指数化投资。其中，除应对赎回所必需的现金类资产之外，其余基金资产严格按照标的指数中股票类资产与债券类资产的比例进行配置。
业绩比较基准	95%×中证股债动态合成期权策略指数收益率+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。
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

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-156,191.78
2.本期利润	-1,342,379.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3376
4.期末基金资产净值	4,007,254.23
5.期末基金份额净值	1.045

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，包含停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	-23.50%	2.34%	-18.82%	2.22%	-4.68%	0.12%

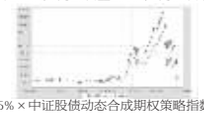
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金

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6月26日至2015年9月30日）



注：1、本基金业绩比较基准为95%×中证股债动态合成期权策略指数收益率+ 5%×活期存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于2013年6月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，2013年12月25日建仓期结束当日除中证短融50指数成份券及备选成份券的投资比例低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定；

3、由于银行间账户开设过程历时较长，2013年12月25日建仓期结束当日尚未完成银行间账户开设，从而导致中证短融50指数成份券及备选成份券的投资比例当日被动未达标；

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		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级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、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	2013-06-26	-	13年（自2002年起）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士，于2002年11月加入兴业证券投资部任投资分析员，于2003年10月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发规经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理，2010年6月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2010年11月起兼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，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，2013年6月起兼任国联安中证股债动态策略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》、《国联安中证股债动态策略指数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，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有超过该证券当日成交量5%的情况。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 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

截止报告期末，本基金份额净值为1.045元，本报告期份额净值增长率为-23.50%，同期业绩比较基准收益率为-18.82%。本报告期内，日均跟踪偏离度为0.16%，年化跟踪误差为3.66%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.5%，以及年化跟踪误差不超过6%的限制。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2015年1月5日-2015年9月30日本基金资产净值低于5000万元。

2015年8月7日-2015年9月30日本基金基金份额持有人数量不满200人。

基金管理人拟调整基金运作方式或召开基金份额持有人大会终止基金运作。

§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	1,027,574.68	24.88
	其中：股票	1,027,574.68	24.88
2	固定收益投资	2,743,526.70	66.42
	其中：债券	2,743,526.70	66.42
	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	224,021.18	5.42
7	其他各项资产	135,644.18	3.28
8	合计	4,130,766.74	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	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	510.30	0.01
C	制造业	4,538.29	0.11
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	1,604.33	0.04
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	540.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	7,192.92	0.18

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,080.06	0.05
B	采矿业	37,756.95	0.94
C	制造业	325,477.68	8.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,548.98	1.31
E	建筑业	47,856.84	1.19
F	批发和零售业	38,720.12	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	52,649.73	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,387.09	1.46
J	金融业	321,128.11	8.01
K	房地产业	37,260.66	0.93
L	租赁和商务服务业	10,785.10	0.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,052.55	0.23
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	24,078.47	0.60
S	综合	2,600.43	0.06
	合计	1,020,381.76	25.46

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项存在尾差。

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股票投资明细

5.3.1期末指数投资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	601318	中国平安	1,240	37,026.40	0.92
2	600036	招商银行	1,810	32,163.70	0.80
3	600016	民生银行	3,313	27,994.85	0.70
4	600900	长江电力	2,685	22,339.20	0.56
5	600000	浦发银行	1,203	20,005.89	0.50
6	601166	兴业银行	1,270	18,491.20	0.46
7	000858	五 粮 液	667	17,161.91	0.43
8	601988	中国银行	4,095	15,233.40	0.38
9	600153	建发股份	867	15,007.77	0.37
10	600519	贵州茅台	75	14,273.25	0.36

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600058	五矿发展	43.00	1,604.33	0.04
2	600498	烽火通信	74.00	1,573.98	0.04
3	600664	哈药股份	82.00	842.96	0.02
4	600267	海正药业	73.00	831.47	0.02
5	000536	华映科技	76.00	750.88	0.02

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	397,585.40	9.92
	其中：政策性金融债	397,585.40	9.92
4	企业债券	2,344,665.00	58.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,276.30	0.03
8	其他	-	-
9	合计	2,743,526.70	68.46

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	122214	12大秦债	23,330	2,344,665.00	58.51
2	018001	国开1301	3,940	397,585.40	9.92
3	110031	航信转债	10	1,276.30	0.03

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,018.97
2	应收证券清算款	40,037.79
3	应收股利	-
4	应收利息	90,627.59
5	应收申购款	1,959.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	135,644.18

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报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600153	建发股份	15,007.77	0.37	重大事项
2	000858	五粮液	17,161.91	0.43	重大事项

5.11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600058	五矿发展	1,604.33	0.04	重大事项
2	000536	华映科技	750.88	0.02	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	4,405,035.73
本报告期基金总申购份额	275,915.87
减：本报告期基金总赎回份额	848,039.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,832,912.43

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

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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中证股债动态策略指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金合同》

3、《国联安中证股债动态策略指数证券投资基金招募说明书》

4、《国联安中证股债动态策略指数证券投资基金托管协议》

5