

基金管理人：国联安基金管理有限公司  
基金托管人：中信银行股份有限公司  
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。

基金托管人中信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。

基金管理人声明以诚实信用、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。投资人风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读该基金的招募说明书。

本报告期内基金无利润分配。

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	国联安心增益债券
基金代码	263030
交易代码	263030
运作方式	契约型，本基金合同生效后一年内封闭运作，基金合同生效满一年后转为开放式基金
基金合同生效日	2010年9月22日
报告期末基金份额总额	382,931,357.72份
投资目标	在控制风险的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

在控制风险的前提下，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

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		-2,702,767.17元
2.本期利润		-8,576,351.65元
3.期初平均基金份额净值		1.02233
4.期末基金份额净值		1.02400(1.0158%)
5.期末可供分配基金份额净值		1.0202

注：本基金合同以及招募说明书中约定，本基金封闭期自2010年6月22日起至2011年6月21日止。自2011年6月22日起，本基金运作方式转为开放式，并打开申购、赎回，转换及定期定额投资业务。

#### § 4 管理人报告

1.基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	任本基金基金经理的日期	任本基金基金经理的期限	说明
蒋海先生，北京大学经济系学士，2007年7月至2009年6月在国泰基金管理有限公司担任研究员助理，2009年6月至今在国泰基金管理有限公司担任研究员、研究部经理、国联安基金管理有限公司基金经理助理，2011年4月起担任国联安基金管理有限公司基金经理，2012年3月起担任国联安安心增益债券基金基金经理，2013年4月起兼任国联安安心增益债券基金基金经理。	2012-06-19	2015-07-03	8年

本基金基金经理，蒋海先生，北京大学经济系学士，2007年7月至2009年6月在国泰基金管理有限公司担任研究员助理，2009年6月至今在国泰基金管理有限公司担任研究员、研究部经理、国联安基金管理有限公司基金经理助理，2011年4月起担任国联安安心增益债券基金基金经理，2012年3月起担任国联安安心增益债券基金基金经理，2013年4月起兼任国联安安心增益债券基金基金经理。

本基金主要投资于债券型基金，属于证券市场中低风险品种，预期收益和预期风险高

于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人声明以诚实信用、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。投资人风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读该基金的招募说明书。

本报告期内基金无利润分配。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

#### § 5 公平交易执行的情况

本基金管理人严格按照《公平交易制度》，用以规范包括投资研究、分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施交易策略与业绩评价等投资管理活动的各个环节。

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机会、投资决策和投资跟踪等方面享有平等的权利机会，在交易时机选择上优先，价格优先的原则下给予指令；如遇符合条件的同一时段内同时具备两个条件时，则按执行时间优先，对投资组合独立核算等。

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区间同向交易成交较少的单边交易量未

发现有明显证据证明该组合存在利益输送的情况。

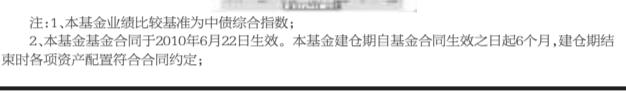
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -1.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%

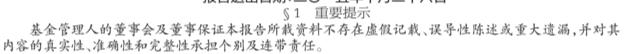
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

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

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.2.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -0.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%

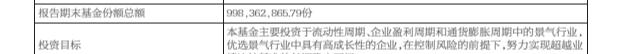
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.3.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -0.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%

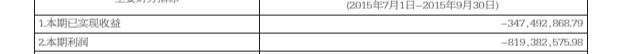
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2.4 自基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.4.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -0.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%

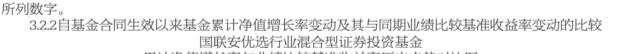
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2.5 自基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.5.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -0.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%

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将低于所列示。

3.2.6 自基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.6.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -0.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%

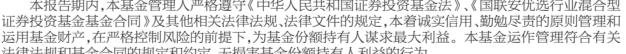
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示。

3.2.7 自基金合同生效以来基金净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安心增益债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年6月22日至2015年9月30日)



注：1.本期业绩比较基准为中债综合指数；

2.本基金合同于2010年6月22日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起6个月，建仓期间

对各项资产配置符合合同约定；

3.2.7.1 报告期基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 -0.39% 0.33% 1.12% 0.08% -25% 0.27%