

# 国联安信心增益债券型证券投资基金

2015年第三季度报告

2015年9月30日

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据。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金基金经理期限 证券从业年限 说明

黄利 本基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理 2012-06-19 2015-07-03 10年 (自2008年10月起) 黄利先生,北京大学经济学硕士。2007年7月至2009年6月在法国巴黎银行(中国)有限公司担任宏观策略研究员,2009年6月至2011年4月在华泰证券(上海)资产管理有限公司担任研究员,2011年4月起加盟国联安基金管理有限公司,曾任权益投资部副经理,2011年5月至2014年12月担任国联安安心增利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月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。

李 涛 本基金基金经理、国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理 2015-03-18 6年 (自2009年10月起) 李涛先生,硕士研究生,注册金融分析师(CFA),金融风险管理师(RM)。2005年1月至2008年6月在晨星资讯(中国)有限公司担任研究员,2008年6月至2009年6月在国联安基金管理有限公司担任研究员,2009年6月起加盟国联安基金管理有限公司,曾任权益投资部副经理,2011年4月至2013年6月在太平洋资产管理(上海)有限公司担任研究员,2013年6月起加盟国联安基金管理有限公司,2013年12月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理,2015年3月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理,2015年6月起兼任国联安保本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 管理人对外报告本期基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人恪守遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安信心增益债券型证券投资基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的约定,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、法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相关法律法规和内部制度,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投资决策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、投资授权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;如遇部分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,对投资流程进行复核。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易未发现有超过法律法规规定的交易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

本报告期内未发现有可能会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

宏观经济方面,2015年3季度在稳增长政策下生产而继续趋弱,工业生产活动持续放缓,主要表现在PMI指数8月份在荣枯线以下,工业企业利润8月份同比下降8%,降幅比7月份扩大5.5%。从政策面看,央行仍然维持了较为宽松的货币环境,财政政策也更加积极,预计未来经济大概率企稳,3季度猪肉价格涨幅加大,但是部分通货膨胀率仍然较低,CPI维持在1%-2%之间波动;而PPI仍然持续为负。目前来看,在通胀率较低的情况下,通胀预期难以出现明显回升,本报告期内,本基金管理人主要采取以下策略:

权益市场在3季度继续受到较大幅度的调整,ipo暂停,从而导致以银行为代表的资产再配置,且蓝筹股进入熊市使得债券收益率大幅下行。持续经济低迷带来信用风险增加,部分不景气行业的信用等级资产存在调整压力。本基金配置以中等信用等级信用债配置为主获取收益为主,此外还通过一二的融资杠杆来获取收益收益。

4.4.2报告期内基金的投资策略和业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-1.39%,同期业绩比较基准收益率为1.12%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

注:1、本基金业绩比较基准为:中债综合指数;2、本基金基金合同于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,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

5.2 基金投资组合报告

注:1、本基金业绩比较基准为:中债综合指数;2、本基金基金合同于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,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

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 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

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 国债投资 20,266,233.30 4.78

2 央行票据 -- --

3 金融债 -- --

其中:政策性金融债 -- --

4 企业债 -- --

5 可转债投资 355,324,360.00 82.76

6 中期票据 70,520,000.00 16.02

7 短期融资券 89,922,000.00 21.19

8 其他 -- --

9 合计 536,012,184.10 126.35

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 1409004 13国债(02) 500,000 54,530,000.00 12.95

2 122122 12国债(附息) 500,000 52,556,000.00 12.40

3 1312153 13国债(02) 350,000 36,363,000.00 8.63

4 122551 12国债(附息) 401,630 34,343,381.30 8.12

5 1409004 14国债(附息) 300,000 33,159,000.00 7.80

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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

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十名贵金属投资明细

序号 贵金属代码 贵金属名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 9999.99 9999.99 9999.99 0.00

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十名权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.9 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.10 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.11 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.12 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.13 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.14 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.15 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.16 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.17 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.18 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.19 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.20 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.21 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.22 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.23 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.24 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.25 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.26 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.27 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.28 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.29 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.30 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.31 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.32 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.33 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.34 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.35 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.36 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.37 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.38 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.39 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.40 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.41 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.42 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.43 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.44 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.45 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.46 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.47 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012 1,463,796.20 0.35

5.48 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权证投资明细

序号 权证代码 权证名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.49 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买入返售金融资产投资明细

序号 返售代码 返售名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.50 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卖出回购金融资产投资明细

序号 回购代码 回购名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000000 000000 000000 0.00

5.51 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

序号 资产代码 资产名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601029 上海机场 134,012