

国联安货币市场证券投资基金

2012 年半年度报告摘要

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人——上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金简称 | 国联安货币 | |
| 基金主代码 | 253050 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2011年1月26日 | |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 235,250,741.59份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国联安货币A | 国联安货币B |
| 下属分级基金的交易代码 | 253050 | 253051 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 64,675,700.87份 | 170,575,040.72份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理，定性分析与量化分析相结合，力争为投资者提供稳定的收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金采取积极的投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测，在此基础上，确定组合久期和类别资产配置比例，把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择，具体包括以下策略：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、利率预期策略 2、收益率曲线策略 3、类属配置策略 4、现金流管理策略 5、套利策略 6、个券选择策略 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对 |

| | |
|--|---|
| | 较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于债券型基金，也低于混合型基金与股票型基金。 |
|--|---|

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-----------------------------------|--------------------|
| 名称 | | 国联安基金管理有限公司 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陆康芸 | 周倩芝 |
| | 联系电话 | 021-38992806 | 021-61618888 |
| | 电子邮箱 | customer.service@gtja-allianz.com | zhouqz@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-38784766/4007000365 | 95528 |
| 传真 | | 021-50151582 | 021-63602540 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼 |

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2012 年 1 月 1 日-2012 年 6 月 30 日） | |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
| | 国联安货币 A | 国联安货币 B |
| 本期已实现收益 | 1,682,874.72 | 2,298,478.77 |
| 本期利润 | 1,682,874.72 | 2,298,478.77 |
| 本期净值收益率 | 2.20% | 2.32% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2012 年 6 月 30 日) | |
| | 国联安货币 A | 国联安货币 B |
| 期末基金资产净值 | 64,675,700.87 | 170,575,040.72 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |

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，由于

货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益要低于所列数字；

3、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 国联安货币 A:

| 阶段 | 份额净值收益率① | 净值收益率标准差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 |
|------------|----------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.3487% | 0.0109% | 0.1162% | 0.0001% | 0.2325% | 0.0108% |
| 过去三个月 | 0.9823% | 0.0081% | 0.3652% | 0.0001% | 0.6171% | 0.0080% |
| 过去六个月 | 2.2004% | 0.0094% | 0.7367% | 0.0001% | 1.4637% | 0.0093% |
| 过去一年 | 3.7229% | 0.0078% | 1.4878% | 0.0001% | 2.2351% | 0.0077% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 4.8655% | 0.0072% | 2.1039% | 0.0001% | 2.7616% | 0.0071% |

注：本基金收益分配按日结转份额。

2. 国联安货币 B:

| 阶段 | 份额净值收益率① | 净值收益率标准差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 |
|------------|----------|-----------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.3683% | 0.0109% | 0.1162% | 0.0001% | 0.2521% | 0.0108% |
| 过去三个月 | 1.0429% | 0.0081% | 0.3652% | 0.0001% | 0.6777% | 0.0080% |
| 过去六个月 | 2.3220% | 0.0094% | 0.7367% | 0.0001% | 1.5853% | 0.0093% |
| 过去一年 | 3.9728% | 0.0078% | 1.4878% | 0.0001% | 2.4850% | 0.0077% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 5.2276% | 0.0072% | 2.1039% | 0.0001% | 3.1237% | 0.0071% |

注：本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安货币市场证券投资基金
份额累计净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011 年 1 月 26 日至 2012 年 6 月 30 日)

1、国联安货币 A



注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于 2011 年 1 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，本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

2、国联安货币 B



注：1、本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同于 2011 年 1 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，本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。本报告期内公司管理着十七只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理） 期限 | | 证券从业 年限 | 说明 |
|----|----|---------------------|------|------------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

国联安货币市场证券投资基金 2012 年半年度报告（摘要）

| | | | | | |
|-----|--|------------|------------|-----------------|--|
| 冯俊 | 本基金基金经理、兼任国联安德盛增利债券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基金经理、债券组合管理部总监 | 2011-01-26 | - | 11 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，现担任债券组合管理部总监，2009 年 3 月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理，2010 年 6 月起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 月起兼任本基金基金经理。 |
| 薛琳 | 本基金基金经理助理 | 2012-02-20 | - | 6 年（自 2006 年起） | 薛琳女士，管理学学士，先后在上海红顶金融研究中心公司担任项目管理、上海国利货币有限公司担任债券交易员，上海长江养老保险股份有限公司担任债券交易员。自 2010 年 6 月起，加盟国联安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理职务。（注：自 2012 年 7 月 11 日起，薛琳女士担任本基金基金经理。该公告于 2012 年 7 月 11 日披露。） |
| 周志远 | 本基金基金经理助理、兼任国联安德盛增利债券证券投资 | 2011-01-27 | 2012-03-22 | 5 年（自 2007 年起） | - |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | 基金基金经 理助理、国 联安信心增 益债券型证 券投资基金 基金经理、 债券研究员 | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

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；
3、冯俊先生于 2012 年 7 月 26 日离任，不再担任本基金基金经理。（2012 年 7 月 26 日公告）

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《国联安货币市场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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年，经济表现出明显下滑的特征。GDP 同比增速、固定资产投资增速、出口和进口增速等数据均低于 2006 年以来的历史平均水平。受存款准备金率下调和降息等因素的影响，货币市场利率稳中有降。债券市场资金面整体趋于宽松，收益率下降较为明显。在保持流动性的前提下，我们配置了一些信用评级可靠，收益较为理想的短期融资券品种。利率市场化进程中，以 Shibor 为定价基准的市场利率有较强的参考意义，是流动性和收益性适配的良好品种。我们适时拉长定存久期，为组合贡献了较好的收益率水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安货币 A 净值收益率为 2.2004%，同期业绩比较基准增长率为 0.7367%。国联安货币 B 净值收益率为 2.3220%，同期业绩比较基准增长率为 0.7367%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第二季度 GDP 同比增长 7.6%，三年来首次跌破 8%，经济增速总体而言呈现下滑状态。各项保增长政策已经密集出台，央行政策放松力度也在逐步加大，随着政策累积效应的逐步显现，估计第三季度 GDP 增速或将会有所反弹。但是投资、消费及工业增加值增速等数据均创近几年新低，经济下滑趋势或仍将延续，我们预计下半年政府可能会继续通过降准降息、加大投资力度等政策刺激消费等措施以推动经济增长。但是我们相信本轮的政策刺激将会远远弱于以 2009 年的经济政策刺激力度，从中长期看，中国经济增长的中枢下移将是大势所趋。在这样的背景下，我们将继续保持流动性和收益率适度均衡的策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方

不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的有关约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付，并只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

本报告期内，本基金已实现收益为 3,981,353.49 元，实际分配收益 3,981,353.49 元，其中向本基金 A 级份额持有人分配利润 1,682,874.72 元，向本基金 B 级份额持有人分配利润 2,298,478.77 元，符合本基金基金合同的约定，不存在应分配但尚未实施分配的情况。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国联安货币市场基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国联安货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金

管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 141,567,365.07 | 41,080,354.63 |
| 结算备付金 | | - | 293,181.82 |
| 存出保证金 | | - | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 90,943,839.93 | 50,023,640.30 |
| 其中：股票投资 | | - | 0.00 |
| 基金投资 | | - | 0.00 |
| 债券投资 | | 90,943,839.93 | 50,023,640.30 |
| 资产支持证券投资 | | - | 0.00 |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 16,000,000.00 | 26,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | 0.00 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 2,740,512.13 | 1,029,651.82 |
| 应收股利 | | - | 0.00 |
| 应收申购款 | | 271,472.26 | 21,019.37 |
| 递延所得税资产 | | - | 0.00 |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | 0.00 |
| 资产总计 | | 251,523,189.39 | 118,447,847.94 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 | 上年度末 2011 年 12 月 31 日 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | 0.00 |
| 交易性金融负债 | | - | 0.00 |
| 衍生金融负债 | | - | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 0.00 |
| 应付证券清算款 | | 16,000,000.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | | 4,093.48 | 992.56 |
| 应付管理人报酬 | | 60,852.87 | 61,632.39 |
| 应付托管费 | | 18,440.26 | 18,676.50 |
| 应付销售服务费 | | 15,665.82 | 7,678.67 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 5,218.52 | 5,904.28 |
| 应交税费 | | - | 0.00 |
| 应付利息 | | - | 0.00 |
| 应付利润 | | - | 0.00 |
| 递延所得税负债 | | - | 0.00 |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 168,176.85 | 366,007.44 |
| 负债合计 | | 16,272,447.80 | 460,891.84 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 235,250,741.59 | 117,986,956.10 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | 0.00 |
| 所有者权益合计 | | 235,250,741.59 | 117,986,956.10 |
| 负债和所有者权益总计 | | 251,523,189.39 | 118,447,847.94 |

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 235,250,741.59 份，其中国联安货币 A 为 64,675,700.87 份，国联安货币 B 为 170,575,040.72 份。

2、本基金于 2011 年 1 月 26 日成立，上年度可比期间为 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日（下同）。

3、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人以及基金托管人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2011 年 1 月 26 日（基金 合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日 |
|--------|-----|--|---|
| 一、收入 | | 4,753,196.21 | 10,176,459.10 |
| 1.利息收入 | | 3,853,559.39 | 9,360,758.92 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------------|---------------------|
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 2,507,338.83 | 1,256,390.39 |
| 债券利息收入 | | 1,196,058.66 | 2,992,033.56 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 150,161.90 | 5,112,334.97 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 899,636.82 | 815,700.18 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 899,636.82 | 815,700.18 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - | - |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |
| 减：二、费用 | | 771,842.72 | 2,044,305.84 |
| 1. 管理人报酬 | | 301,793.72 | 1,131,424.35 |
| 2. 托管费 | | 91,452.61 | 342,855.80 |
| 3. 销售服务费 | | 102,795.89 | 364,485.06 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | - | 0.00 |
| 5. 利息支出 | | 81,270.61 | 7,426.98 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 81,270.61 | 7,426.98 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 194,529.89 | 198,113.65 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 3,981,353.49 | 8,132,153.26 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | - | - |

注：本基金于 2011 年 1 月 26 日成立，上年度可比期间为 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日（下同）。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安货币市场证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|---------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 117,986,956.10 | - | 117,986,956.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,981,353.49 | 3,981,353.49 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 117,263,785.49 | - | 117,263,785.49 |
| 其中：1. 基金申购款 | 752,681,043.64 | - | 752,681,043.64 |
| 2. 基金赎回款 | -635,417,258.15 | - | -635,417,258.15 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -3,981,353.49 | -3,981,353.49 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 235,250,741.59 | 0.00 | 235,250,741.59 |
| 项目 | 上年度可比期间 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 2,845,589,169.30 | - | 2,845,589,169.30 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 8,132,153.26 | 8,132,153.26 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -2,654,338,385.01 | - | -2,654,338,385.01 |
| 其中：1. 基金申购款 | 242,581,114.64 | - | 242,581,114.64 |
| 2. 基金赎回款 | -2,896,919,499.65 | - | -2,896,919,499.65 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | -8,132,153.26 | -8,132,153.26 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 191,250,784.29 | 0.00 | 191,250,784.29 |

注：本基金于 2011 年 1 月 26 日成立，上年度可比期间为 2011 年 1 月 26 日（基金合同生效日）至 2011 年 6 月 30 日（下同）。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：邵杰军，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会《关于核准国联安货币市场证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]1587号)批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国联安货币市场证券投资基金基金合同》于2011年1月6日至2011年1月21日募集,发售募集扣除认购费后的有效认购资金及其利息共计人民币2,845,589,169.30元,其中A类(基金代码253050)人民币1,418,637,246.29元,B类(基金代码253051)人民币1,426,951,923.01元;折合2,845,589,169.30份基金份额,其中A类基金份额1,418,637,246.29份,B类基金份额1,426,951,923.01份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证,并出具了KPMG-B(2011)CR No.0002号验资报告。基金合同于2011年1月26日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安货币市场证券投资基金基金合同》和《国联安货币市场证券投资基金基金合同招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为

- 1、现金;
- 2、通知存款;
- 3、短期融资券;
- 4、剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
- 5、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
- 6、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;
- 7、期限在1年以内(含1年)的债券回购;
- 8、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
- 9、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,

报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安货币市场投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制本财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则(2006)的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注 6.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财税字[1998]55 号文、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (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。
- (d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，自 2005 年 6 月 13 日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50%计算个人所得

税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------|
| 国联安基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 基金托管人 |
| 国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”） | 基金管理人的股东 |
| 安联集团 | 基金管理人的股东 |
| 中德安联人寿保险有限公司（“中德安联”） | 基金管理人的股东控制的公司 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间 2011年1月26日（基金合同生效日）至 2011年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------------|---|--------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 回购成交总 额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 |
| 国泰君安 | - | - | 15,350,000,000.00 | 100.00% |

6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月 30日 | 上年度可比期间 2011年1月26日（基金合同生效日） 至2011年6月30日 |
|---------------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 301,793.72 | 1,131,424.35 |
| 其中：支付销售机构的客户 维护费 | 132,959.60 | 315,503.15 |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月 30日 | 上年度可比期间 2011年1月26日（基金合同生效日） 至2011年6月30日 |
|--------------------|--------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托 管费 | 91,452.61 | 342,855.80 |

注：支付基金托管人上海浦发银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | |
|----------------|---|----------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国联安货币 A | 国联安货币 B | 合计 |
| 浦发银行 | 28,458.28 | 3,149.75 | 31,608.03 |
| 国泰君安 | 684.82 | 0.00 | 684.82 |
| 合计 | 29,143.10 | 3,149.75 | 32,292.85 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国联安货币 A | 国联安货币 B | 合计 |

| | | | |
|------|------------|-----------|------------|
| 浦发银行 | 331,114.04 | 11,510.76 | 342,624.80 |
| 国泰君安 | 62.19 | 0.00 | 62.19 |
| 合计 | 331,176.23 | 11,510.76 | 342,686.99 |

注：1、支付基金销售机构的国联安货币 A 基金份额的销售服务费按前一日国联安货币 A 基金资产净值 0.25%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日国联安货币 A 基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2、支付基金销售机构的国联安货币 B 基金份额的销售服务费按前一日国联安货币 B 基金资产净值 0.01%的年费率计提，每日计提，按月支付。计算公式为：每日国联安货币 B 基金份额应计提的基金销售服务费 = 前一日该类基金份额的基金资产净值 × 0.01% / 当年天数。

3、对于由国联安货币 B 降级为国联安货币 A 的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级日后的下一个工作日起适用国联安货币 A 基金份额持有人的费率；对于由国联安货币 A 升级为国联安货币 B 的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其升级日后的下一个工作日起享受 B 级基金份额持有人的费率。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | | | | |
|---|---------------|----------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| - | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2011年1月26日（基金合同生效日）至2011年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 浦发银行 | 20,402,364.66 | 202,569,934.22 | - | - | - | - |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内，基金管理人未投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | 上年度可比期间 2011年1月26日（基金合同生效日）至 2011年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------|---|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浦发银行 | 141,567,365.07 | 203,715.89 | 10,640,886.69 | 1,138,913.04 |

注：本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2012 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 0 元。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末（2012 年 6 月 30 日）未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的 |
|----|----|----|---------|
|----|----|----|---------|

| | | | 比例（%） |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 固定收益投资 | 90,943,839.93 | 36.16 |
| | 其中：债券 | 90,943,839.93 | 36.16 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 16,000,000.00 | 6.36 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 141,567,365.07 | 56.28 |
| 4 | 其他各项资产 | 3,011,984.39 | 1.20 |
| 5 | 合计 | 251,523,189.39 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例（%） | |
|----|--------------|---------------|---------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 2.50 | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 104 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 124 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 24 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金不存在投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况。

根据本基金基金合同规定，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使不符合规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1 | 30 天以内 | 15.97 | 6.80 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 17.00 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 42.52 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 8.52 | 0.00 |
| 4 | 90 天(含)—180 天 | 8.60 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180 天(含)—397 天(含) | 21.54 | 0.00 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 6 | 合计 | 105.63 | 6.80 |

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 20,032,975.24 | 8.52 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,032,975.24 | 8.52 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,910,864.69 | 30.14 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 90,943,839.93 | 38.66 |

| | | | |
|---|----------------------|---------------|------|
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 20,032,975.24 | 8.52 |
|---|----------------------|---------------|------|

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量 (张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| 1 | 100236 | 10 国开 36 | 200,000 | 20,032,975.24 | 8.52 |
| 2 | 041265003 | 12 江宁水 CP001 | 100,000 | 10,237,514.55 | 4.35 |
| 3 | 041258014 | 12 獐子岛 CP001 | 100,000 | 10,141,175.68 | 4.31 |
| 4 | 041160004 | 11 沈阳水务 CP001 | 100,000 | 10,121,759.47 | 4.30 |
| 5 | 041159014 | 11 苏汇鸿 CP002 | 100,000 | 10,119,056.60 | 4.30 |
| 6 | 041260013 | 12 皖盐业 CP001 | 100,000 | 10,113,336.40 | 4.30 |
| 7 | 041269005 | 12 天音 CP001 | 100,000 | 10,104,915.75 | 4.30 |
| 8 | 041253009 | 12 恒逸 CP001 | 100,000 | 10,073,106.24 | 4.28 |

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|-------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 33 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.45% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.06% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.21% |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

7.8.3 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 2,740,512.13 |
| 4 | 应收申购款 | 271,472.26 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,011,984.39 |

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额 级别 | 持有 人户 数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|-------------|----------------------|---------------|----------------|------------|---------------|------------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |
| 国联安 货币 A | 1,413 | 45,771.90 | 12,175,740.89 | 18.83% | 52,499,959.98 | 81.17% |
| 国联安 货币 B | 6 | 28,429,173.45 | 160,287,387.85 | 93.97% | 10,287,652.87 | 6.03% |
| 合计 | 1,419 | 165,786.29 | 172,463,128.74 | 73.31% | 62,787,612.85 | 26.69% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|-----------------------|---------|-----------|----------|
| 基金管理公司所有从业人 员持有本基金 | 国联安货币 A | 50,098.57 | 0.077% |
| | 国联安货币 B | - | - |
| | 合计 | 50,098.57 | 0.0213% |

注：1、截止本报告期末，本公司高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为 0；本公司基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；

2、截止本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国联安货币 A | 国联安货币 B |
|--------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2011 年 1 月 26 日)基金份额总额 | 1,418,637,246.29 | 1,426,951,923.01 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 25,974,034.38 | 92,012,921.72 |
| 本报告期基金总申购份额 | 396,117,041.89 | 356,564,001.75 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 357,415,375.4 | 278,001,882.75 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 64,675,700.87 | 170,575,040.72 |

注：总申购份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换入份额；总赎回份额包含本报告期内发生的基金份额级别调整和转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2012 年 3 月 3 日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十一次会议审议通过，聘任邵杰军先生为公司总经理。上述事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告，并经中国证券监督管理委员会审核批准（证监许可[2012]264 号）。

2、2012 年 3 月 24 日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周浩先生为公司督察长。上述事项已按规定向中国证券监督管理委员会及其上海监管局报告，并经中国证券监督管理委员会审核批准（证监许可[2012]369 号）。

3、2012 年 4 月 7 日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第二十八次会议审议通过，周泉恭先生不再担任公司副总经理。上述变更事项，已按有关规定向中国证券监督管理委员会基金监管部和上海监管局报告。

4、2012 年 4 月 21 日，基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告。经公司第三届董事会第三十次会议审议通过，王峰先生不再担任公司副总经理。上述变更事项，已按有关规定向中国证券监督管理委员会基金监管部和上海监管局报告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、 专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用

标准为：

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。
- F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|----------------------|------|--------------------------|----------------|----------------------|------|--------------------------|
| | 成交金额 | 占当期 债券成 交总额 的比例 | 成交金额 | 占当期回 购成交总 额的比例 | 成交金额 | 占当期 权证成 交总额 的比例 |
| 国泰君安证 券股份有限 公司 | - | - | 340,000,000.00 | 100.00% | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况

国联安基金管理有限公司
二〇一二年八月二十七日