

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)2015年半年度报告摘要

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)
2015年半年度报告摘要
2015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：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年八月二十八日

1. 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月26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。

自2015年3月23日国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力A和双力B份额终止上市起，原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6月30日止。

2. 基金简介

2.1. 基金基本情况

2.1.1. 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
交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	17,524,284.29份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年5月20日

2.1.2. 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
交易代码	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
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
报告期末基金份额总额	18,332,807.68份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年4月16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)2015年半年度报告摘要

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	150070	162510
报告期末下属分级基金的份额总额	6,744,926.00 份	6,744,927.00 份	4,842,954.68 份

注：国联安双力中小板综指分级证券投资基金之双力A、双力B基金份额自2015年3月23日起终止上市。

2.2. 基金产品说明

2.2.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

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)
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。

2.2.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

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。

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)2015 年半年度报告摘要

业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+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。		
下属分级基金的风险收益特征	双力 A：低风险低收益。	双力 B：高风险高收益。	国安双力：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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	田青
	联系电话	021-38992806	010-67595096
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853

2.4. 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

3.1.1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 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)2015 年半年度报告摘要

本期已实现收益	5,987,386.27
本期利润	4,889,627.69
加权平均基金份额本期利润	0.2933
本期基金份额净值增长率	26.85%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.7886
期末基金资产净值	38,417,518.49
期末基金份额净值	2.192

注：1、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；

2、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；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.1.2. 基金净值表现

3.1.2.1. 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-14.01%	3.76%	-11.91%	3.46%	-2.10%	0.30%
过去三个月	22.12%	2.93%	24.89%	2.74%	-2.77%	0.19%
自基金份额转换日次日起至至今	26.85%	2.81%	29.42%	2.63%	-2.57%	0.18%

注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

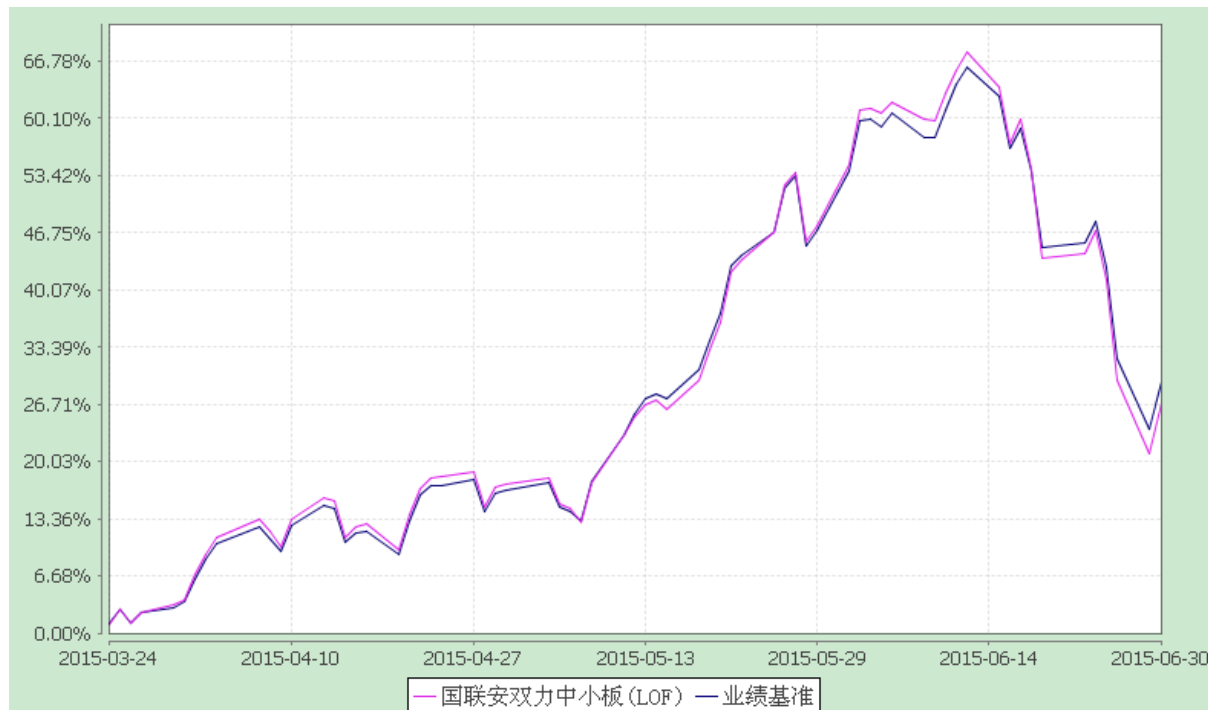
2、本基金份额转换日次日（2015 年 3 月 24 日）起至报告期末未满半年；

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。

3.1.2.2. 自基金转型以来基金份额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

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
 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
 (2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日)



- 注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；
- 2、本基金份额转换日次日（2015 年 3 月 24 日）起至报告期末未满半年；
- 3、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；
- 4、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；
- 5、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。

3.1.3.

3.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

3.2.1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 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)2015 年半年度报告摘要

本期已实现收益	3,477,500.04
本期利润	9,611,963.05
加权平均基金份额本期利润	0.4304
本期基金份额净值增长率	35.96%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 3 月 23 日)
期末可供分配基金份额利润	0.4163
期末基金资产净值	31,670,880.78
期末基金份额净值	1.728

注：1、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；

2、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；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2.2. 基金净值表现

3.2.2.1. 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月 (2015 年 3 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)	17.79%	1.27%	17.00%	1.22%	0.79%	0.05%
过去三个月 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)	35.96%	1.24%	37.47%	1.24%	-1.51%	0.00%
过去六个月 (2014 年 10 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)	34.16%	1.35%	34.11%	1.35%	0.05%	0.00%

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)2015 年半年度报告摘要

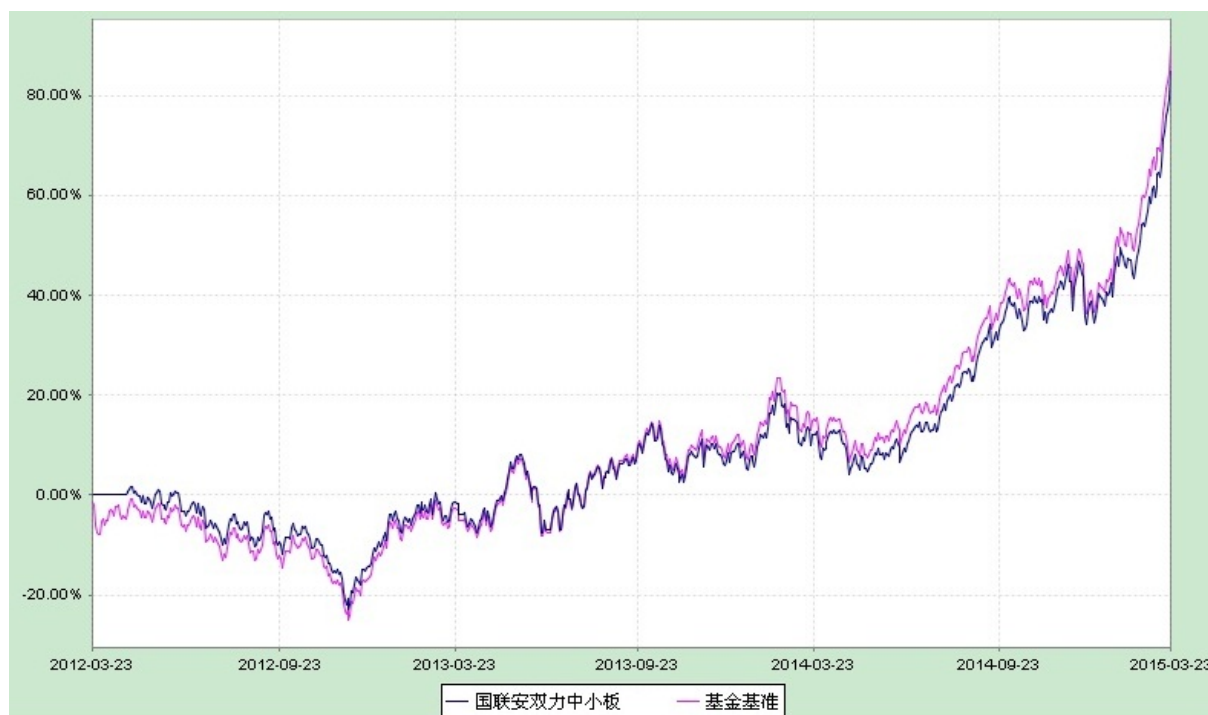
过去一年 (2014 年 4 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)	72.11%	1.17%	72.72%	1.16%	-0.61%	0.01%
过去三年 (2012 年 4 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日)	84.64%	1.29%	106.09%	1.30%	-21.45%	-0.01%
自基金合同 生效起至基 金份额转换 日	84.64%	1.28%	89.62%	1.31%	-4.98%	-0.03%

注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、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。

3.2.2.2. 自基金合同生效以来基金份额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

国联安双力中小板综指分级证券投资基金
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
(2012 年 3 月 23 日至 2015 年 3 月 23 日)



注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于2012年3月23日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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。

3.2.3.

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。截至本报告期末，公司共管理二十八只开放式基金。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

研究与客户服务的成功实践，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		
黄志钢	本基金基金经理、兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理	2012-03-23	2015-06-04	8年 (自2007年起)	黄志钢先生，硕士，先后在海通期货担任研究员、国元证券股份有限公司担任衍生产品部高级经理。黄志钢先生于2008年10月加盟国联安基金管理有限公司，曾担任金融工程分析师。2010年11月起，担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助理。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助理。2012年3月至2015年6月，兼任国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理。2012年6月起至2013年7月兼任国联安双佳信用分级债券型证券投资基金基金经理。2013年8月至2015年6月兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。
冒浩	本基金基金经理、兼任国联安中证医药100指数证券投资基	2015-05-29	-	5年 (自2010年起)	冒浩，英国帝国理工大学硕士研究生毕业，2009年加入国联安基金管理有限公司，从事量化投资相关工作。先后担任基金经理助理、基金经理。2015年5月起担任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。

	金基金 经理				2015年5月起兼任国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理。
冒浩	本基金 基金经 理助理	2015-04-02	2015-05-28	5年 (自 2010年 起)	-

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》、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)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. 管理人对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

在报告期内，本基金采取市值优先和行业分层的抽样方法来复制中小板综合指数。在处理日常的申购赎回、新增成份股、流

通股本变动、成份股长期停牌等事件过程中,综合考虑交易成本、个股和行业权重偏离等因素进行组合调整,将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

4.4.2. 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末(2015年6月30日),本基金份额净值为2.192。自本基金份额转换日次日(2015年3月24日)起至本报告期期末,本基金份额净值增长率为26.85%,同期业绩比较基准收益率为29.42%。自本基金份额转换日次日起至本报告期期末,日均跟踪偏离度为0.18%,年化跟踪误差为3.92%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

截止本基金份额转换日(2015年3月23日),原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的份额净值为1.728。自本报告期期初(2015年1月1日)起至本基金份额转换日,原国联安双力中小板综指分级证券投资基金的份额净值增长率为35.96%,同期业绩比较基准收益率为37.47%。自本报告期期初起至本基金份额转换日,日均跟踪偏离度为0.10%,年化跟踪误差为2.32%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

4.5. 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年二季度,从宏观经济面来看,宏观经济延续探底的走势。从需求端来看,消费保持稳定,出口略有改善,投资继续下滑;从供给端来看,工业产出弱势反弹(工业增加值从3月5.6%升至5月6.1%)。从资本市场来看,去年以来资金入市和股市上涨的正反馈在6月被打破,股市去杠杆导致A股出现严重踩踏。从政策面来看,在经济增速疲弱,6月银行间市场利率上升,以及A股严重下跌的背景下,央行同时出台了降息,降准措施。预计在资金面总体宽松、政策刺激和改革红利不断释放的预期推动下,A股有望止跌反弹。

优质中小市值公司继续肩负经济转型的重任,而我们也判断优秀的中小公司也将在这轮泡沫清洗以后将继续享受政策红利,为投资人带来良好的收益。

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

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定,以及本基金实际运作情况,本基金(包括双力中小板份额、双力A份额、双力B份额)分级运作期内,不进行收益分配;转型后本基金本报告期未进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

2015年1月5日-2015年2月2日、2015年2月5日-2015年6月4日本基金资产净值低于5000万元。

基金管理人拟调整本基金运作方式,加大营销力度,提升基金规模。

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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3. 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6. 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

6.1.1. 资产负债表

会计主体:国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

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)2015年半年度报告摘要

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日
资 产:		
银行存款	6.1.4.7.1	3,494,242.03
结算备付金		14,573.17
存出保证金		4,096.58
交易性金融资产	6.1.4.7.2	35,851,350.44
其中：股票投资		35,851,350.44
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
应收证券清算款		787,445.59
应收利息	6.1.4.7.5	675.81
应收股利		-
应收申购款		32,131.07
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	32,566.42
资产总计		40,217,081.11
负债和所有者权益		本期末 2015年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		1,685,452.86
应付管理人报酬		30,912.33
应付托管费		8,990.14
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.1.4.7.7	24,084.38
应交税费		-

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)2015年半年度报告摘要

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.8	50,122.91
负债合计		1,799,562.62
所有者权益：		
实收基金	6.1.4.7.9	16,394,640.31
未分配利润	6.1.4.7.10	22,022,878.18
所有者权益合计		38,417,518.49
负债和所有者权益总计		40,217,081.11

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.192 元，基金份额总额 17,524,284.29 份。

2、本基金于 2015 年 3 月 24 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 24 日（基金转型后首日）至 2015 年 6 月 30 日，无上年度数据（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网站的半年度报告正文。

6.1.2. 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		5,117,094.08
1.利息收入		7,222.27
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	7,222.27
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,165,317.88
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	6,037,263.39
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-

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)2015年半年度报告摘要

贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.14	-
股利收益	6.1.4.7.15	128,054.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.16	-1,097,758.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	42,312.51
减：二、费用		227,466.39
1. 管理人报酬		76,449.04
2. 托管费		22,425.10
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.1.4.7.18	41,949.40
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.1.4.7.19	86,642.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,889,627.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,889,627.69

注：本基金于2015年3月24日转型，本财务报表的实际编制期间为2015年3月24日（基金转型后首日）至2015年6月30日，无上年度数据（下同）。

6.1.3. 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2015年3月24日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015年3月24日至2015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）	17,150,609.79	14,520,270.99	31,670,880.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,889,627.69	4,889,627.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变	-755,969.48	2,612,979.50	1,857,010.02

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)2015 年半年度报告摘要

动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	13,329,113.98	23,560,216.11	36,889,330.09
2.基金赎回款	-14,085,083.46	-20,947,236.61	-35,032,320.07
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	16,394,640.31	22,022,878.18	38,417,518.49

注：本基金于 2015 年 3 月 24 日转型，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 3 月 24 日（基金转型后首日）至 2015 年 6 月 30 日，无上年度数据（下同）。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.1.4. 报表附注

6.1.4.1. 基金基本情况

国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来。根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》原国联安双力中小板综指分级证券投资基金为契约型基金，封闭期为 3 年期。国联安双力中小板综指分级证券投资基金在深圳证券交易所交易上市，至 2015 年 3 月 23 日终止上市。自 2015 年 3 月 24 日(转型后首日)起，国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满后自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》，国联安双力中小板综指分级证券投资基金在封闭期届满后，按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对双力 A 份额和双力 B 份额计算封闭期末基金份额净值，并以各自的份额净值为基础，按照国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金份额净值转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的份额。于 2015 年 3 月 23 日(基金份额转换日)日终，双力 A 份额转换前份额数为 6,744,926.00 份，转换比例为 0.61668539，转换后对应本基金份额数为 4,159,497.00 份；双力 B 份额转换前份额数为 6,744,927.00 份，转换比例为

1.38331461, 转换后对应基金份额数为 9,330,356.00 份。本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司根据基金合同约定,对双力 A、双力 B 的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所审核同意,本基金于 2015 年 5 月 20 日在深圳证券交易所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为: 95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(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。

6.1.4.2. 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本基金的收益分配原则遵循了《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定。

6.1.4.3. 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的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况、2015 年 3 月 24 日(转型后首日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.1.4.4. 重要会计政策和会计估计

6.1.4.4.1. 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

6.1.4.4.2. 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.1.4.4.3. 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

—以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债(包括交易性金融资产或金融负债)

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债及衍生工具属于此类。

—应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

—其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

6.1.4.4.4. 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

6.1.4.4.5. 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

6.1.4.4.6. 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.1.4.4.7. 实收基金

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.1.4.4.8. 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.1.4.4.9. 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本

无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.1.4.4.10. 费用的确认和计量

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。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的规定，基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率逐日计提。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的规定，指数使用许可费的计费时间从本基金合同生效日起开始计算。指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.02% 年费率每日计算，逐日累计，按季支付。基金合同生效之日所在季度的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，指数使用许可费收取下限为每季度 5 万元，即不足 5 万元时按照 5 万元收取。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，

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)2015 年半年度报告摘要

待摊或预提计入基金损益。

6.1.4.4.11. 基金的收益分配政策

分级运作期内，本基金(包括双力中小板份额、双力 A 份额、双力 B 份额)不进行收益分配。本基金分级运作期满并转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)后，每一基金份额享有同等分配权。场外份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式。基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。场内份额收益分配只采用现金红利一种方式，基金份额持有人不能自行选择。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.1.4.4.12. 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称“《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》”)，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.1.4.5. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.1.4.5.1. 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

6.1.4.5.2. 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），自 2015 年 3 月 26 日起，本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。于 2015 年 3 月 26 日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

6.1.4.5.3. 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

6.1.4.6. 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入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 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，

暂减按 25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(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。

6.1.4.7. 关联方关系

6.1.4.7.1. 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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.1.4.7.2. 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
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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

6.1.4.8. 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。

6.1.4.8.1. 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.8.1.1. 股票交易

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

6.1.4.8.1.2. 权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

6.1.4.8.1.3. 债券交易

本报告期内，本基金与关联方无债券交易。

6.1.4.8.1.4. 债券回购交易

本报告期，本基金与关联方无债券回购交易。

6.1.4.8.1.5. 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。

6.1.4.8.2. 关联方报酬

6.1.4.8.2.1. 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

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)2015 年半年度报告摘要

2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	76,449.04
其中：支付销售机构的客户维护费	21,901.72

注：1、在本基金分级运作期内，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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×1.0%/当年天数；

2、在本基金分级运作期到期后，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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×0.75%/当年天数。

6.1.4.8.2.2. 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 3 月 24 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	22,425.10

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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×0.22%/当年天数。

6.1.4.8.3. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.1.4.8.4. 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.8.4.1. 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，基金管理人未投资本基金。

6.1.4.8.4.2. 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

本期末其他关联方均未投资本基金。

6.1.4.8.5. 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	
	2015年3月24日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	3,494,242.03	7,185.82

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

6.1.4.8.6. 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，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.1.4.8.7. 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

6.1.4.9. 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.9.1. 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（2015 年 6 月 30 日）未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.1.4.9.2. 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002001	新和成	2015-06-30	重大事项停牌	17.09	2015/7/13	18.49	5,809.00	100,245.17	99,275.81	-
002003	伟星股份	2015-06-05	重大事项停牌	16.17	-	-	3,077.00	22,669.93	49,755.09	-
002012	凯恩股份	2015-05-28	重大事项停牌	14.00	2015/7/1	12.6	4,330.00	23,988.20	60,620.00	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项停牌	44.08	-	-	2,196.00	8,788.74	96,799.68	-
002020	京新药业	2015-04-16	重大事项停牌	29.44	2015/8/10	26.1	1,882.00	11,376.02	55,406.08	-
002045	国光电器	2015-06-01	重大事项停牌	13.92	2015/7/14	12.53	3,773.00	18,569.44	52,520.16	-
002069	獐子岛	2015-06-01	重大事项停牌	19.76	-	-	3,093.00	61,436.98	61,117.68	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大事项停牌	33.00	-	-	8,700.00	294,930.00	287,100.00	-
002080	中材科技	2015-04-21	重大事项停牌	23.23	-	-	4,474.00	46,166.22	103,931.02	-
002091	江苏国泰	2015-06-01	重大事项停牌	22.45	-	-	4,389.00	81,068.87	98,533.05	-
002097	山河智能	2015-05-21	重大事项停牌	17.75	-	-	4,251.00	29,790.62	75,455.25	-
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大事项停牌	18.93	-	-	4,158.00	66,214.36	78,710.94	-

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)2015 年半年度报告摘要

002109	兴化股份	2015-05-08	重大事项停牌	8.54	-	-	3,465.00	26,919.50	29,591.10	-
002110	三钢闽光	2015-04-02	重大事项停牌	11.47	-	-	9,276.00	64,434.74	106,395.72	-
002143	印纪传媒	2015-06-30	重大事项停牌	32.01	2015/7/1	33.5	1,346.00	7,908.84	43,085.46	-
002147	方圆支承	2015-06-01	重大事项停牌	17.90	-	-	2,699.00	19,290.67	48,312.10	-
002170	芭田股份	2015-05-26	重大事项停牌	26.12	2015/7/28	23.51	2,844.00	14,426.80	74,285.28	-
002183	怡亚通	2015-06-01	重大事项停牌	65.78	-	-	4,758.00	33,068.53	312,981.24	-
002191	劲嘉股份	2015-06-18	重大事项停牌	19.22	-	-	8,884.00	77,308.55	170,750.48	-
002203	海亮股份	2015-04-27	重大事项停牌	11.83	-	-	7,449.00	34,546.32	88,121.67	-
002209	达意隆	2015-06-08	重大事项停牌	26.54	2015/7/13	23.89	1,619.00	11,273.40	42,968.26	-
002211	宏达新材	2014-12-10	重大事项停牌	15.11	-	-	4,699.00	35,245.43	71,001.89	-
002212	南洋股份	2015-04-27	重大事项停牌	13.08	-	-	3,671.00	17,592.95	48,016.68	-
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	重大事项停牌	67.20	2015/7/13	60.48	2,837.00	86,033.96	190,646.40	-
002226	江南化工	2015-06-08	重大事项停牌	13.18	-	-	7,812.00	50,745.51	102,962.16	-
002238	天威视讯	2015-06-29	重大事项停牌	23.76	-	-	2,720.00	29,386.71	64,627.20	-
002242	九阳股份	2015-06-15	重大事项停牌	19.45	2015/7/7	17.51	3,669.00	28,949.98	71,362.05	-
002269	美邦服饰	2015-05-22	重大事项停牌	11.29	2015/7/2	10.67	12,725.00	108,234.11	143,665.25	-
002276	万马股份	2015-06-30	重大事项停牌	34.15	2015/7/20	30.74	4,981.00	60,500.92	170,101.15	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项停牌	37.29	-	-	2,912.00	18,575.14	108,588.48	-
002298	鑫龙电器	2015-06-25	重大事项停牌	28.16	2015/7/2	25.34	2,388.00	19,177.34	67,246.08	-
002303	美盈森	2015-06-09	重大事项停牌	47.70	2015/7/13	21.43	2,326.00	14,314.17	110,950.20	-
002308	威创股份	2015-06-12	重大事项停牌	23.15	-	-	5,756.00	72,377.59	133,251.40	-
002309	中利科技	2015-06-02	重大事项停牌	33.39	2015/7/21	30.05	1,642.00	18,422.14	54,826.38	-

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)2015 年半年度报告摘要

002310	东方园林	2015-05-27	重大事项停牌	28.57	-	-	2,824.00	47,605.51	80,681.68	-
002316	键桥通讯	2015-02-17	重大事项停牌	14.95	-	-	5,376.00	39,066.89	80,371.20	-
002320	海峡股份	2015-06-26	重大事项停牌	27.43	-	-	2,433.00	23,308.14	66,737.19	-
002325	洪涛股份	2015-06-03	重大事项停牌	31.15	-	-	2,755.00	31,499.49	85,818.25	-
002345	潮宏基	2015-05-22	重大事项停牌	19.58	-	-	3,634.00	17,077.39	71,153.72	-
002348	高乐股份	2015-06-30	重大事项停牌	15.63	-	-	4,900.00	113,729.00	76,587.00	-
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项停牌	44.35	-	-	3,085.00	67,136.94	136,819.75	-
002367	康力电梯	2015-06-02	重大事项停牌	20.90	-	-	6,612.00	41,588.75	138,190.80	-
002369	卓翼科技	2015-06-03	重大事项停牌	20.03	-	-	2,867.00	21,712.68	57,426.01	-
002374	丽鹏股份	2015-06-30	重大事项停牌	23.34	2015/7/13	22.5	2,800.00	84,280.00	65,352.00	-
002375	亚厦股份	2015-06-17	重大事项停牌	23.96	2015/7/20	26.29	6,753.00	100,373.07	161,801.88	-
002377	国创高新	2015-06-26	重大事项停牌	13.32	2015/7/3	11.99	3,366.00	11,531.16	44,835.12	-
002398	建研集团	2015-06-08	重大事项停牌	28.49	2015/7/13	18.5	2,167.00	22,133.66	61,737.83	-
002404	嘉欣丝绸	2015-06-10	重大事项停牌	14.37	2015/7/23	12.93	4,838.00	16,611.71	69,522.06	-
002406	远东传动	2015-06-30	重大事项停牌	11.45	2015/7/1	12	2,836.00	13,962.35	32,472.20	-
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项停牌	20.97	2015/7/29	18.6	5,215.00	41,430.97	109,358.55	-
002417	*ST元达	2015-02-09	重大事项停牌	17.51	2015/7/28	11.25	3,986.00	32,648.69	69,794.86	-
002443	金洲管道	2015-05-18	重大事项停牌	17.07	2015/7/13	14.27	5,346.00	33,649.40	91,256.22	-
002445	中南重工	2015-06-02	重大事项停牌	51.39	-	-	3,157.00	118,413.98	162,238.23	-
002461	珠江啤酒	2015-06-04	重大事项停牌	26.40	2015/7/24	23.76	3,242.00	29,819.17	85,588.80	-
002498	汉缆股份	2015-06-30	重大事项停牌	20.57	2015/7/20	22.63	6,100.00	138,074.32	125,477.00	-
002511	中顺洁柔	2015-06-01	重大事项停牌	14.18	2015/7/14	12.76	5,551.00	48,042.98	78,713.18	-

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)2015 年半年度报告摘要

002522	浙江众成	2015-06-23	重大事项停牌	30.60	2015/7/13	27.54	2,588.00	15,190.93	79,192.80	-
002527	新时达	2015-06-15	重大事项停牌	30.92	-	-	2,824.00	17,845.26	87,318.08	-
002528	英飞拓	2015-06-25	重大事项停牌	15.18	2015/7/2	13.66	6,664.00	70,458.30	101,159.52	-
002545	东方铁塔	2015-05-19	重大事项停牌	26.79	-	-	1,396.00	22,060.16	37,398.84	-
002546	新联电子	2015-06-17	重大事项停牌	33.16	2015/7/16	29.84	1,756.00	20,482.57	58,228.96	-
002557	洽洽食品	2015-06-29	重大事项停牌	16.38	2015/8/24	14.74	7,552.00	133,343.85	123,701.76	-
002574	明牌珠宝	2015-06-04	重大事项停牌	22.90	-	-	6,096.00	56,660.21	139,598.40	-
002581	万昌科技	2015-06-18	重大事项停牌	132.01	2015/7/1	118.81	1,211.00	58,897.38	159,864.11	-
002589	瑞康医药	2015-05-21	重大事项停牌	104.25	-	-	812.00	16,402.65	84,651.00	-
002602	世纪华通	2014-12-05	重大事项停牌	18.97	-	-	5,222.00	21,484.42	99,061.34	-
002605	姚记扑克	2015-06-16	重大事项停牌	29.01	-	-	2,493.00	31,934.74	72,321.93	-
002617	露笑科技	2015-06-23	重大事项停牌	53.28	2015/7/2	47.95	818.00	7,226.16	43,583.04	-
002620	瑞和股份	2015-06-09	重大事项停牌	58.49	2015/8/13	52.55	816.00	12,918.18	47,727.84	-
002636	金安国纪	2015-06-29	重大事项停牌	22.10	-	-	3,068.00	9,177.90	67,802.80	-
002647	宏磊股份	2015-06-05	重大事项停牌	35.40	-	-	1,632.00	12,528.86	57,772.80	-
002649	博彦科技	2015-06-01	重大事项停牌	83.81	2015/8/18	75.43	950.00	27,484.03	79,619.50	-
002662	京威股份	2015-05-15	重大事项停牌	17.84	2015/8/13	16.06	2,315.00	24,358.73	41,299.60	-
002665	首航节能	2015-06-30	重大事项停牌	27.70	2015/7/1	30	3,992.00	75,392.57	110,578.40	-
002667	鞍重股份	2015-04-07	重大事项停牌	23.79	-	-	1,186.00	15,457.11	28,214.94	-
002676	顺威股份	2015-04-20	重大事项停牌	26.94	2015/7/29	24.25	653.00	8,540.92	17,591.82	-

6.1.4.9.3. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.9.3.1. 银行间市场债券正回购

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)2015 年半年度报告摘要

截至本报告期末 2015 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。

6.1.4.9.3.2. 交易所市场债券正回购

截至本报告期末（2015 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。

6.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

6.2.1. 资产负债表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 3 月 23 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015 年 3 月 23 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.2.4.7.1	1,456,596.02	1,220,850.88
结算备付金		-	-
存出保证金		3,847.48	2,387.84
交易性金融资产	6.2.4.7.2	29,588,092.96	25,615,228.54
其中：股票投资		29,588,092.96	25,615,228.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收证券清算款		882,009.39	832,405.72
应收利息	6.2.4.7.5	461.06	403.24
应收股利		-	-
应收申购款		228,642.13	33,738.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	4,608.23	-
资产总计		32,164,257.27	27,705,014.51

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)2015 年半年度报告摘要

负债和所有者权益		本期末 2015 年 3 月 23 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		381,120.47	775,623.11
应付管理人报酬		19,183.62	25,181.91
应付托管费		4,220.41	5,540.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.2.4.7.7	12,203.88	4,711.22
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.8	76,648.11	89,479.19
负债合计		493,376.49	900,535.44
所有者权益:			
实收基金	6.2.4.7.9	17,150,609.79	19,730,852.65
未分配利润	6.2.4.7.10	14,520,270.99	7,073,626.42
所有者权益合计		31,670,880.78	26,804,479.07
负债和所有者权益总计		32,164,257.27	27,705,014.51

注：1、报告截止日 2015 年 3 月 23 日，基金份额净值 1.728 元，基金份额总额 18,332,807.68 份。其中国联安双力 A 中小板综指份额 6,744,926.00 份；国联安双力 B 中小板综指份额 6,744,927.00 份；国联安双力中小板综指份额 4,842,954.68 份。

2、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网站的半年度报告正文。

6.2.2. 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日

单位：人民币元

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)2015 年半年度报告摘要

项 目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	-	9,800,698.55	1,565,270.43
1.利息收入	-	5,866.46	7,895.26
其中：存款利息收入	6.2.4.7. 11	5,866.46	7,895.26
债券利息收入	-	-	-
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	3,623,755.34	1,736,386.91
其中：股票投资收益	6.2.4.7. 12	3,620,570.89	1,505,156.60
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.2.4.7. 13	-	-
资产支持证券投资	-	-	-
收益	-	-	-
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.2.4.7. 14	-	-
股利收益	6.2.4.7. 15	3,184.45	231,230.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7. 16	6,134,463.01	-190,607.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7. 17	36,613.74	11,595.45
减：二、费用	-	188,735.50	503,405.96
1. 管理人报酬	-	70,146.59	168,496.62
2. 托管费	-	15,432.29	37,069.24

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)2015 年半年度报告摘要

3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.2.4.7. 18	23,578.17	16,905.42
5. 利息支出	-	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-	-
6. 其他费用	6.2.4.7. 19	79,578.45	280,934.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	9,611,963.05	1,061,864.47
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	9,611,963.05	1,061,864.47

6.2.3. 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双力中小板综指分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 3 月 23 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）	19,730,852.65	7,073,626.42	26,804,479.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,611,963.05	9,611,963.05
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）	-2,580,242.86	-2,165,318.48	-4,745,561.34
其中：1.基金申购款	17,002,156.60	7,726,679.29	24,728,835.89
2.基金赎回款	-19,582,399.46	-9,891,997.77	-29,474,397.23
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）	-	-	-

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) 2015 年半年度报告摘要

五、期末所有者权益 (基金净值)	17,150,609.79	14,520,270.99	31,670,880.78
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	35,731,949.68	3,153,441.50	38,885,391.18
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	1,061,864.47	1,061,864.47
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)	-7,912,977.12	-871,138.09	-8,784,115.21
其中：1.基金申购款	1,036,843.65	148,559.86	1,185,403.51
2.基金赎回款	-8,949,820.77	-1,019,697.95	-9,969,518.72
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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	27,818,972.56	3,344,167.88	31,163,140.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.2.4. 报表附注

6.2.4.1. 基金基本情况

国联安双力中小板综指分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011] 1593 号文)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《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 809,109,186.27 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(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。

6.2.4.2. 会计报表的编制基础

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

本基金的收益分配原则遵循了《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》的有关规定。

6.2.4.3. 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的要求,真实、完整地反映了本基金2015年3月23日(封闭期届满日)的财务状况、2015年1月1日至2015年3月23日(封闭期届满日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2.4.4. 重要会计政策和会计估计

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。

6.2.4.5. 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更,未发生过会计差错。

6.2.4.6. 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、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:

(1) 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。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 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。

(4) 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2013年1月1日起,对所取得的股息红利收入根据持有期限计提个人所得税:持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额,上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5) 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。

(6) 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。

6.2.4.7. 关联方关系

6.2.4.7.1. 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

本报告期内,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.2.4.7.2. 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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	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

6.2.4.8. 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。

6.2.4.8.1. 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1. 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

6.2.4.8.1.2. 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

6.2.4.8.1.3. 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

6.2.4.8.1.4. 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

6.2.4.8.1.5. 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

6.2.4.8.2. 关联方报酬

6.2.4.8.2.1. 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 3月23日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	70,146.59	168,496.62
其中：支付销售机构的客户维护 费	5,555.34	11,608.56

注：1、在本基金分级运作期内，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 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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×1.0%/当年天数；

2、在本基金分级运作期到期后，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 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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×0.75%/当年天数。

6.2.4.8.2.2. 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年
----	-----------------------	----------------------------

	3月23日	6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,432.29	37,069.24

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，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×0.22%/当年天数。

6.2.4.8.3. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间内，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.2.4.8.4. 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1. 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，基金管理人未投资本基金。

6.2.4.8.4.2. 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。

6.2.4.8.5. 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 2015年1月1日至2015年3月 23日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
	建设银行	1,456,596.02	5,444.99	1,854,930.79

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

6.2.4.8.6. 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，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.2.4.8.7. 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。

6.2.4.9. 期末（2015年3月23日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1. 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（2015年3月23日）未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.2.4.9.2. 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

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) 2015 年半年度报告摘要

						价				
002010	传化股份	2015-01-05	重大事项停牌	9.07	2015-06-23	9.98	5,344.00	40,717.84	48,470.08	-
002037	久联发展	2015-02-03	重大事项停牌	19.66	2015-04-28	21.63	2,963.00	41,021.97	58,252.58	-
002086	东方海洋	2015-03-23	重大事项停牌	16.28	2015-04-01	16.99	3,724.00	48,756.28	60,626.72	-
002089	新海宜	2015-03-18	重大事项停牌	18.17	2015-04-14	19.99	4,158.00	64,170.04	75,550.86	-
002122	天马股份	2015-03-06	重大事项停牌	8.00	2015-03-31	8.80	9,120.00	64,356.87	72,960.00	-
002123	荣信股份	2014-12-22	重大事项停牌	9.22	2015-03-26	10.14	4,370.00	59,162.52	40,291.40	-
002171	精诚铜业	2014-11-24	重大事项停牌	17.99	2015-05-11	14.38	6,609.00	76,244.36	118,895.91	-
002176	江特电机	2015-01-27	重大事项停牌	15.75	2015-04-14	17.33	3,015.00	28,920.59	47,486.25	-
002180	艾派克	2014-11-06	重大事项停牌	23.51	2015-05-18	25.86	1,457.00	16,373.31	34,254.07	-
002211	宏达新材	2014-12-10	重大事项停牌	8.93	-	-	4,699.00	35,245.43	41,962.07	-
002255	海陆重工	2015-03-04	重大事项停牌	14.46	2015-05-26	15.91	2,111.00	29,530.30	30,525.06	-
002279	久其软件	2015-02-09	重大事项停牌	56.70	2015-04-13	44.11	2,128.00	19,384.92	120,657.60	-
002298	鑫龙电器	2014-09-30	重大事项停牌	12.34	2015-04-10	9.87	6,388.00	51,300.19	78,827.92	-
002301	齐心集团	2015-03-19	重大事项停牌	16.45	2015-04-21	18.10	5,322.00	34,044.06	87,546.90	-
002316	键桥通讯	2015-02-17	重大事项停牌	11.01	-	-	5,376.00	39,066.89	59,189.76	-
002317	众生药业	2015-01-07	重大事项停牌	24.49	2015-04-02	21.77	1,789.00	28,266.20	43,812.61	-
002321	华英农业	2015-03-19	重大事项停牌	10.02	2015-03-31	10.18	6,554.00	50,487.56	65,671.08	-
002331	皖通科技	2014-11-10	重大事项停牌	27.62	2015-03-25	16.96	2,033.00	14,642.50	56,151.46	-
002350	北京科锐	2015-03-06	重大事项停牌	14.38	2015-04-13	15.82	2,276.00	29,260.48	32,728.88	-
002356	浩宁达	2015-03-13	重大事项停牌	45.32	2015-03-24	44.90	834.00	15,070.86	37,796.88	-
002675	东诚药业	2014-10-10	重大事项停牌	24.18	2015-04-23	26.60	2,867.00	39,079.28	69,324.06	-
00241	三元	2015-	重大事	10.71	2015-	11.25	3,986.00	32,648.69	42,690.06	-

7	达	02-09	项停牌		07-28					
002441	众业达	2015-03-05	重大事 项停牌	29.17	2015-03-27	32.09	1,859.00	29,459.43	54,227.03	-
002513	蓝丰生化	2015-02-09	重大事 项停牌	12.11	2015-05-15	13.32	3,083.00	35,613.21	37,335.13	-
002548	金新农	2015-02-03	重大事 项停牌	10.84	2015-05-12	11.92	4,761.00	31,196.93	51,609.24	-
002596	海南瑞泽	2015-03-04	重大事 项停牌	12.81	2015-06-09	14.09	3,044.00	32,415.68	38,993.64	-
002602	世纪华通	2014-12-05	重大事 项停牌	26.58	-	-	2,611.00	21,484.42	69,400.38	-
002617	露笑科技	2014-12-01	重大事 项停牌	23.41	2015-04-29	25.75	818.00	7,226.16	19,149.38	-
002629	仁智油服	2015-03-23	重大事 项停牌	11.10	2015-03-24	10.91	4,546.00	31,521.73	50,460.60	-
002656	卡奴迪路	2015-03-16	重大事 项停牌	17.64	2015-06-09	19.28	830.00	16,233.22	14,641.20	-
002660	茂硕电源	2015-02-10	重大事 项停牌	9.54	2015-05-26	10.49	2,011.00	15,606.13	19,184.94	-

6.2.4.9.3. 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.3.1. 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 3 月 23 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。

6.2.4.9.3.2. 交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2015 年 3 月 23 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. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

(报告期: 2015年3月24日-2015年6月30日)

7.1.1. 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 (%)
----	----	----	---------------

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) 2015 年半年度报告摘要

1	权益投资	35,851,350.44	89.14
	其中：股票	35,851,350.44	89.14
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	3,508,815.20	8.72
7	其他各项资产	856,915.47	2.13
8	合计	40,217,081.11	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。

7.1.2. 期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1. 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	425,521.84	1.11
B	采矿业	267,361.23	0.70
C	制造业	26,624,238.79	69.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,879.78	0.59
E	建筑业	1,476,807.42	3.84
F	批发和零售业	1,317,023.94	3.43
G	交通运输、仓储和邮政业	179,414.16	0.47
H	住宿和餐饮业	116,502.82	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,330,670.35	6.07
J	金融业	1,133,514.59	2.95
K	房地产业	731,965.66	1.91
L	租赁和商务服务业	690,737.93	1.80
M	科学研究和技术服务业	166,525.83	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	124,020.00	0.32

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) 2015 年半年度报告摘要

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	41,166.10	0.11
S	综合	-	-
	合计	35,851,350.44	93.32

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.1.2.2. 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.1.3. 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

7.1.3.1. 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	16,603	743,814.40	1.94
2	002304	洋河股份	6,533	453,128.88	1.18
3	002024	苏宁云商	27,487	420,551.10	1.09
4	002673	西部证券	12,980	368,242.60	0.96
5	002252	上海莱士	5,588	365,678.72	0.95
6	002142	宁波银行	16,175	342,101.25	0.89
7	002183	怡亚通	4,758	312,981.24	0.81
8	002075	沙钢股份	8,700	287,100.00	0.75
9	002081	金螳螂	9,240	260,475.60	0.68
10	002500	山西证券	14,050	254,164.50	0.66

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.1.3.2. 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.1.4. 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1. 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	367,534.00	0.96
2	002673	西部证券	315,462.00	0.82

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) 2015 年半年度报告摘要

3	002075	沙钢股份	294,930.00	0.77
4	002465	海格通信	252,725.00	0.66
5	002024	苏宁云商	247,475.00	0.64
6	002475	立讯精密	234,396.00	0.61
7	002493	荣盛石化	232,120.00	0.60
8	002491	通鼎互联	208,361.65	0.54
9	002304	洋河股份	206,901.00	0.54
10	002573	清新环境	197,802.00	0.51
11	002312	三泰控股	192,511.00	0.50
12	002563	森马服饰	191,772.00	0.50
13	002049	同方国芯	189,804.00	0.49
14	002423	中原特钢	181,192.00	0.47
15	002151	北斗星通	172,644.00	0.45
16	002483	润邦股份	169,320.00	0.44
17	002498	汉缆股份	167,500.00	0.44
18	002142	宁波银行	167,099.00	0.43
19	002318	久立特材	162,360.00	0.42
20	002178	延华智能	161,910.00	0.42

7.1.4.2. 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	352,541.00	0.92
2	002304	洋河股份	234,735.39	0.61
3	002024	苏宁云商	224,166.55	0.58
4	002142	宁波银行	151,547.00	0.39
5	002065	东华软件	148,315.00	0.39
6	002252	上海莱士	142,887.00	0.37
7	002445	中南重工	141,810.00	0.37
8	002673	西部证券	138,322.00	0.36
9	002500	山西证券	129,478.00	0.34
10	002055	得润电子	126,951.95	0.33
11	002594	比亚迪	125,636.00	0.33
12	002202	金风科技	120,921.00	0.31
13	002241	歌尔声学	119,930.58	0.31
14	002129	中环股份	117,734.00	0.31
15	002187	广百股份	116,545.00	0.30
16	002450	康得新	115,076.45	0.30
17	002146	荣盛发展	113,459.00	0.30
18	002284	亚太股份	106,366.05	0.28

19	002208	合肥城建	102,404.44	0.27
20	002540	亚太科技	101,954.00	0.27

7.1.4.3. 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	14,865,493.39
卖出股票的收入（成交）总额	13,541,740.72

注：不考虑相关交易费用。

7.1.5. 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。

7.1.6. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.1.7. 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。

7.1.8. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1. 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。

7.1.10.2. 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。

7.1.11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1. 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。

7.1.11.2. 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。

7.1.11.3. 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。

7.1.12. 投资组合报告附注

7.1.12.1. 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。

7.1.12.2. 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。

7.1.12.3. 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	4,096.58
2	应收证券清算款	787,445.59
3	应收股利	-
4	应收利息	675.81
5	应收申购款	32,131.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	32,566.42
8	其他	-
9	合计	856,915.47

7.1.12.4. 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。

7.1.12.5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.1.12.5.1. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002183	怡亚通	312,981.24	0.81	重大事项停牌
2	002075	沙钢股份	287,100.00	0.75	重大事项停牌

7.1.12.5.2. 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

国联安双力中小板综指分级证券投资基金

(报告期：2015年1月1日-2015年3月23日)

7.2.1. 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	权益投资	29,588,092.96	91.99
	其中：股票	29,588,092.96	91.99
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	1,456,596.02	4.53
7	其他各项资产	1,119,568.29	3.48
8	合计	32,164,257.27	100.00

7.2.2. 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1. 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	441,133.70	1.39
B	采矿业	282,094.78	0.89
C	制造业	21,363,003.79	67.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	258,907.98	0.82
E	建筑业	1,447,185.07	4.57
F	批发和零售业	1,341,159.14	4.23
G	交通运输、仓储和邮政业	231,524.69	0.73
H	住宿和餐饮业	46,124.60	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,940,117.48	6.13
J	金融业	913,626.54	2.88
K	房地产业	742,432.11	2.34

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) 2015 年半年度报告摘要

L	租赁和商务服务业	482,824.16	1.52
M	科学研究和技术服务业	49,340.00	0.16
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	48,618.92	0.15
S	综合	-	-
	合计	29,588,092.96	93.42

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2.2. 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3. 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

7.2.3.1. 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	18003	537389.55	1.70%
2	002304	洋河股份	5103	404259.66	1.28%
3	002024	苏宁云商	28228	366117.16	1.16%
4	002252	上海莱士	5688	302032.80	0.95%
5	002081	金螳螂	10340	299446.40	0.95%
6	002142	宁波银行	16475	297209.00	0.94%
7	002065	东华软件	8300	274066.00	0.87%
8	002500	山西证券	14250	240397.50	0.76%
9	002241	歌尔声学	7055	227876.50	0.72%
10	002594	比亚迪	4114	218494.54	0.69%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.2.3.2. 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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.4. 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1. 累计买入金额超出期末基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

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) 2015 年半年度报告摘要

1	002241	歌尔声学	314,845.00	1.17
2	002736	国信证券	234,118.00	0.87
3	002557	洽洽食品	145,075.00	0.54
4	002415	海康威视	134,310.14	0.50
5	002304	洋河股份	102,192.00	0.38
6	002031	巨轮股份	101,042.00	0.38
7	002187	广百股份	90,564.00	0.34
8	002089	新海宜	84,881.00	0.32
9	002095	生意宝	69,842.00	0.26
10	002594	比亚迪	67,923.00	0.25
11	002565	上海绿新	67,665.00	0.25
12	002252	上海莱士	65,608.00	0.24
13	002024	苏宁云商	58,497.00	0.22
14	002142	宁波银行	57,355.00	0.21
15	002605	姚记扑克	57,063.96	0.21
16	002543	万和电气	55,088.00	0.21
17	002649	博彦科技	53,911.00	0.20
18	002433	太安堂	53,040.00	0.20
19	002195	二三四五	53,016.00	0.20
20	002520	日发精机	50,455.00	0.19

7.2.4.2. 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	284,785.38	1.06
2	002304	洋河股份	220,389.87	0.82
3	002024	苏宁云商	175,468.49	0.65
4	002252	上海莱士	136,478.92	0.51
5	002142	宁波银行	122,004.66	0.46
6	002557	洽洽食品	106,749.99	0.40
7	002241	歌尔声学	105,367.05	0.39
8	002500	山西证券	103,947.92	0.39
9	002081	金螳螂	99,508.16	0.37
10	002594	比亚迪	96,014.26	0.36
11	002450	康得新	89,284.02	0.33
12	002195	二三四五	89,281.00	0.33
13	002202	金风科技	87,352.00	0.33
14	002001	新和成	85,081.34	0.32
15	002649	博彦科技	84,838.00	0.32
16	002051	中工国际	84,705.14	0.32

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) 2015 年半年度报告摘要

17	002065	东华软件	80,512.34	0.30
18	002363	隆基机械	76,573.73	0.29
19	002496	辉丰股份	74,065.50	0.28
20	002303	美盈森	72,643.08	0.27

7.2.4.3. 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,004,502.33
卖出股票的收入（成交）总额	9,786,671.81

注：不考虑相关交易费用。

7.2.5. 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。

7.2.6. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.2.7. 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。

7.2.8. 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.2.9. 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1. 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。

7.2.10.2. 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。

7.2.11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1. 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。

7.2.11.2. 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。

7.2.11.3. 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。

7.2.12. 投资组合报告附注

7.2.12.1. 本报告期内，双力分级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。

7.2.12.2. 双力分级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。

7.2.12.3. 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	3,847.48
2	应收证券清算款	882,009.39
3	应收股利	-
4	应收利息	461.06
5	应收申购款	228,642.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	4,608.23
8	其他	-
9	合计	1,119,568.29

7.2.12.4. 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。

7.2.12.5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.2.12.5.1. 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.2.12.5.2. 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8. 基金份额持有人信息

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

(报告期：2015年3月24日-2015年6月30日)

8.1.1. 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

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) 2015 年半年度报告摘要

		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,258	13,930.27	3,622,098.00	20.67%	13,902,186.29	79.33%

8.1.2. 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司 —传统保险产品	2796973	15.96%
2	郑淑女	964651	5.50%
3	杨震	772344	4.41%
4	徐步云	459306	2.62%
5	李锦山	409644	2.34%
6	朱洪宏	348595	1.99%
7	吴才云	324603	1.85%
8	杨楚杰	309328	1.77%
9	贵州省农村信用社 联合社企业年金计划—中国银行股份 有限公司	233121	1.33%
10	司明辉	216259	1.23%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

(报告期：2015年1月1日-2015年3月23日)

8.2.1. 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
国联安双 力 A 中小 板综指 (场内简 称：双力 A)	219	30,798.75	4,206,355.00	62.36%	2,538,571.00	37.64%
国联安双 力 B 中小 板综指 (场内简	398	16,947.05	293,930.00	4.36%	6,450,997.00	95.64%

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) 2015 年半年度报告摘要

称：双力 B)						
国联安双 力中小板 综指（场 内简称： 国安双力）	617	7,849.20	1,228,277.00	25.36%	3,614,677.68	74.64%
合计	1,234	14,856.41	5,728,562.00	31.25%	12,604,245.68	68.75%

8.2.2. 期末上市基金前十名持有人

国联安双力A中小板综指（场内简称：双力A）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司 —传统保险产品	3706355	54.95%
2	郑淑女	500053	7.41%
3	国泰君安证券股份 有限公司	500000	7.41%
4	方向	222119	3.29%
5	杨楚杰	150012	2.22%
6	黄乐平	100010	1.48%
7	肖瑞华	100010	1.48%
8	张兰华	98700	1.46%
9	李荣	68600	1.02%
10	金关妹	50012	0.74%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双力B中小板综指（场内简称：双力B）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	周昭玲	763894	11.33%
2	郑淑女	424553	6.29%
3	杨凯	300027	4.45%
4	杨震	290000	4.30%
5	朱洪宏	252000	3.74%
6	中国对外经济贸易 信托有限公司—外 贸信托·或然赋利 1期证券	193730	2.87%
7	陈波	174200	2.58%
8	刘升喜	158600	2.35%
9	杨楚杰	150012	2.22%
10	刘丽丽	138700	2.06%

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)2015 年半年度报告摘要

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

国联安双力中小板综指（场内简称：国安双力）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司—传统保险产品	511318	10.56%
2	贵州省农村信用社联合社企业年金计划—中国银行股份有限公司	233121	4.81%
3	杨克艳	200752	4.15%
4	余胜义	158760	3.28%
5	李国伟	148963	3.08%
6	郑礼贞	110611	2.28%
7	李伟	106000	2.19%
8	杜焯	105807	2.18%
9	中国化学工程集团公司企业年金计划—中信银行股份有限公司	91121	1.88%
10	川渝中烟工业有限责任公司企业年金计划—招商银行	90223	1.86%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,914.86	0.02%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、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均为 0；本基金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

9.1. 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

(报告期: 2015年3月24日-2015年6月30日)

单位: 份

基金合同生效日 (2015 年 3 月 24 日) 基金份额总额	18,332,807.68
本报告期基金总申购份额	14,247,312.14
减: 本报告期基金总赎回份额	15,055,835.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,524,284.29

9.2. 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

(报告期: 2015年1月1日-2015年3月23日)

单位: 份

项目	国联安双力 A 中小板综指 (场内简称: 双力 A)	国联安双力 B 中小板综指 (场内简称: 双力 B)	国联安双力中小板综指 (场内简称: 国安双力)
基金合同生效日 (2012 年 3 月 23 日) 基金份额总额	179,140,090.00	179,140,091.00	450,829,005.27
本报告期期初基金份额总额	8,144,124.00	8,144,125.00	4,805,198.46
本报告期基金总申购份额	-	-	18,174,486.62
减: 本报告期基金总赎回份额	-	-	20,935,126.40
本报告期基金拆分变动份额	-1,399,198.00	-1,399,198.00	2,798,396.00
本报告期期末基金份额总额	6,744,926.00	6,744,927.00	4,842,954.68

注: 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

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. 2015 年 5 月 29 日, 基金管理人发布《国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告》。增聘冒浩先生担任本基金的基金经理。
2. 2015 年 6 月 4 日, 基金管理人发布《国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金经理变更公告》。黄志钢先生不再担任本基金的基金经理。
3. 2015 年 6 月 6 日, 基金管理人发布关于《国联安基金管理有限公司高级管理

人员变更公告》。自该日起谭晓雨女士担任我司总经理一职。公司董事长庾启斌先生不再代为履行总经理职责。上述事项已经 2015 年 4 月 7 日召开的国联安基金管理有限公司第四届董事会第十五次会议审议通过。

4. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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监管部门稽查或处罚的情况

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	
国信证券股份有限公司	1	8,452,657.11	100.00%	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成

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)2015 年半年度报告摘要

		交总额 的比例		额的比例		交总额 的比例
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

国联安基金管理有限公司
二〇一五年八月二十八日